

中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资 基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告	20
§7 年度财务报表	23

7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 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.....	63
8.7 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.....	63
8.8 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.....	63
8.9 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.....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
§9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.4 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.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	68
§ 11 重大事件揭示.....	69
11.1 基金份额持有人大会决议.....	69
11.2 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.....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
11.4 基金投资策略的改变.....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	78
13.2 存放地点.....	78
13.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 沪市 ETF
场内简称	500 沪市 ETF
基金主代码	510440
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012 年 8 月 24 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	22,058,261.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 沪市指数（代码：000802）
风险收益特征	本基金为股票基金，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。本基金为指数型基金，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	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 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	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	-4,677,459.10	-3,986,029.89	-1,474,892.33
本期利润	-2,082,891.28	-8,908,499.31	-2,501,554.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0894	-0.3759	-0.1940
本期加权平均净值利润率	-4.83%	-20.96%	-9.08%
本期基金份额净值增长率	0.82%	-17.21%	33.41%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	11,423,745.91	16,023,482.35	21,515,676.44
期末可供分配基金份额利润	0.5179	0.7264	0.8943
期末基金资产净值	40,656,287.93	40,318,215.27	53,113,263.00
期末基金份额净值	1.843	1.828	2.208
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	84.30%	82.80%	120.80%

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）。

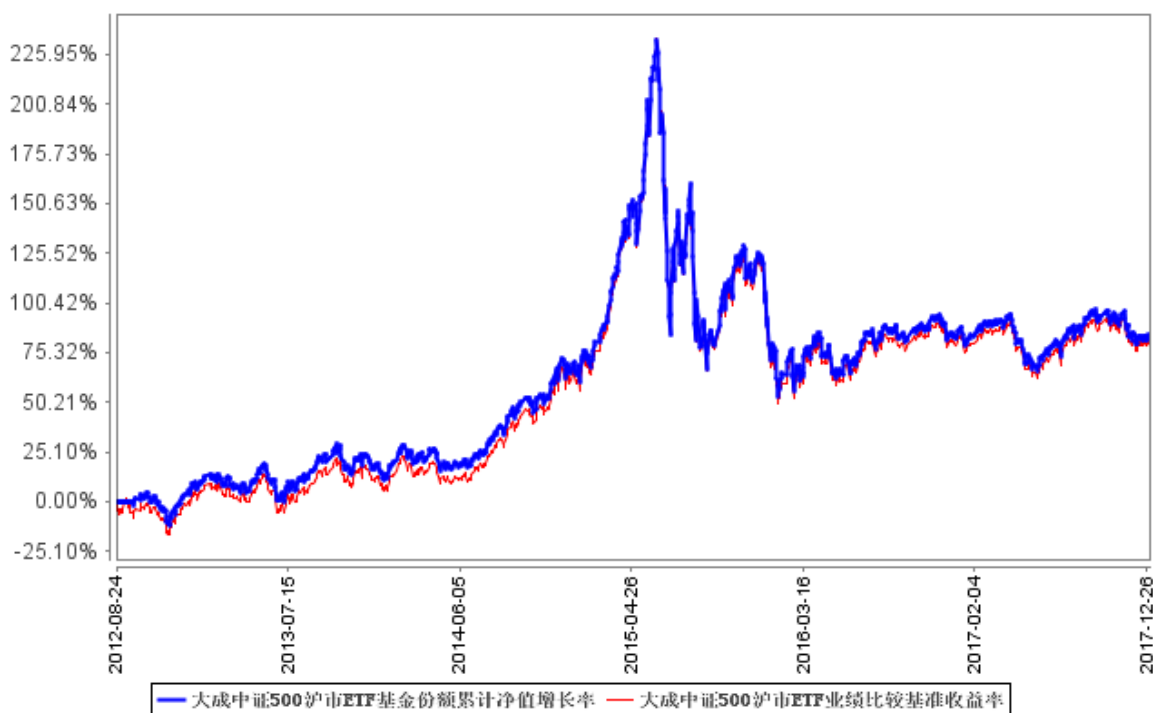
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.90%	0.98%	-4.43%	0.99%	-0.47%	-0.01%
过去六个月	3.08%	0.96%	3.94%	0.97%	-0.86%	-0.01%
过去一年	0.82%	0.92%	1.23%	0.93%	-0.41%	-0.01%
过去三年	11.36%	2.07%	12.48%	2.08%	-1.12%	-0.01%
过去五年	77.55%	1.80%	83.91%	1.82%	-6.36%	-0.02%

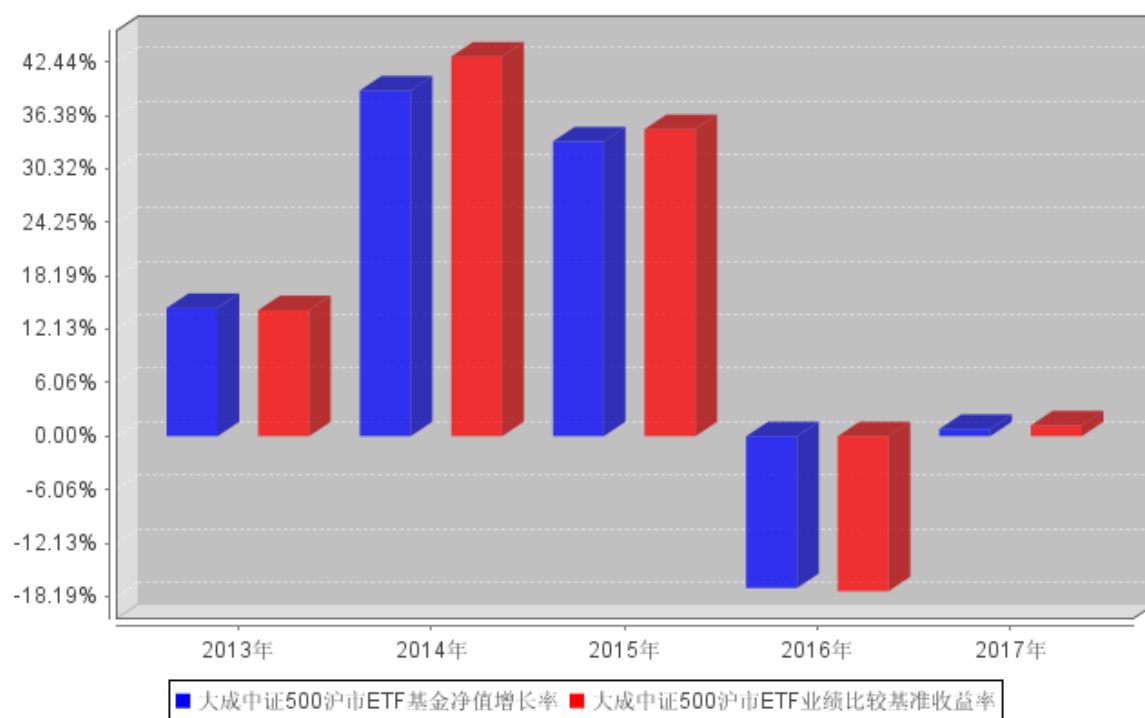
自基金合同生效起至今	84.30%	1.77%	81.51%	1.80%	2.79%	-0.03%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未有利润分配事项。

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金，5 只 QDII 基金及 76 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		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2012 年 8 月 24 日	-	13 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 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

					<p>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>
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	2017 年 7 月 3 日	8 年	<p>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</p>

					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
刘淼女士	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	9 年	北京大学 MBA。2008 年 4 月至 2011 年 5 月任招商基金管理有限公司基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计、股票投资部风控员兼投委会秘书、数量与指数投资部数量分析师。2017 年 9 月 14 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 100 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、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金和中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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。

4.3.3 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 14 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，宏观经济总体比较平稳。虽然金融去杠杆持续进行，M2 增速放缓，但通过一系列措施，经济仍然获得了良好的增速，总体工业利润增速回升。在环保督查、供给侧等政策影响下，经济发展结构化差异较为明显，大型国企与中小型民企境况迥异，上游行业盈利明显优于中下游

行业。国际方面，整体环境较为友好。主要发达经济体开始复苏，外需持续改善，以原油为首的大宗商品价格攀升至高位。而美元全年疲弱，人民币则相对美元保持强势。

资本市场方面，除了传统的基本面、流动性等因素外，相关政策也对行情产生了较大的影响。债券市场全年表现一般，并在四季度再度急速下跌。股票市场则更为波折。上半年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。后来，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。也正是从二季度开始，市场分化开始加剧。在业绩确定、维稳预期、加入 MSCI、打新底仓等多重因素的共同作用下，以中证 100 指数为代表的蓝筹股开始稳定上涨，直到年底才略有回调；在存量博弈的另一面，相当多股票在蓝筹股的虹吸效应下，处于无人问津的境地。全年市场基准沪深 300 指数上涨 21.78%，不可谓不强，而成长股的代表指数创业板指则下跌 10.67%。在行业方面，食品饮料、家用电器表现最为亮眼，大金融和周期板块也有较好表现，而纺织服装、传媒、国防军工等业绩欠佳的板块则下跌较多。

本基金标的指数中证 500 沪市指数上涨 1.23%，涨幅小于大盘。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。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 1.843 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.82%，业绩比较基准收益率为 1.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的年度，宏观经济不确定性有所增加。美国推行弱美元政策，意在吸引资金回流美国，在其目的达到后，美元有可能开始反弹。届时新兴市场将面临挑战，外汇压力也会增大。国内方面，不同层面的矛盾交织存在。去杠杆的大背景下，整体流动性有所下降，虽然政策上支持资金脱虚向实，但多数企业的融资成本仍将高企，制约经济复苏。史无前例的供给侧改革确实实地修复了上游企业利润，但相应地，中下游企业利润受到挤压。若涨价压力顺利通过中下游行业传导到终端，则通胀将会抬头，制约货币政策放松的空间。

对于明年股市，我们持相对谨慎的态度。从基本面来看，行业分化将确实地反映到上市公司盈利状况中，中下游行业盈利低于预期的可能性很大；从资金面来看，金融整肃未完成之前，金融市场流动性将会趋势性下行，尤其是过去急速发展的影子银行系统，有可能成为流动性收缩的

催化剂；从估值来看，虽然中小市值股票已经开始回调，但成长性下降后，当前估值仍然偏高，而大型蓝筹在经历了长时间上涨后，即使没有泡沫也难言低估；最后，目前监管政策更有利于维持蓝筹行情，但未来仍有一定不确定性。总体来说，站在当前的时点，A 股市场风险大于机会，在风险释放后，股市才会迎来性价比较高的投资机会。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

(五) 以多种方式加强合规教育与培训, 提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规, 并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题, 提供法律依据, 对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门, 避免了业务发展中的盲目性, 及时防范风险, 维护了基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会, 公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户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、风险管理部和专户投资部负责关注相关投资品种的动态, 评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种; 提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量; 定期对估值政策和程序进行评价, 以保证其持续适用; 基金运营部负责日常的基金资产的估值业务, 执行基金估值政策, 并负责与托管行沟通估值调整事项; 监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性, 监督估值委员会工作流程中的风险控制, 并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行, 并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制, 基金经理及投资经理作为估值小组成员, 对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感, 向估值委员会提供估值参考信息, 参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券, 基金管理人及时启动特别估值程序, 由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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”）在中证 500 沪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 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金全体基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金全体基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金全体基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金全体基金管理层(以下简称“管理层”)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如</p>

	<p>适用), 并运用持续经营假设, 除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金不能持</p>

	<p>续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吴翠蓉 高鹤
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2018 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	456,065.87	314,298.90
结算备付金		-	4,151.86
存出保证金		235.80	294.62
交易性金融资产	7.4.7.2	40,401,447.84	40,148,572.59
其中：股票投资		40,401,447.84	40,148,572.59
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	99.07	65.58
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		40,857,848.58	40,467,383.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		17,136.07	17,996.18
应付托管费		3,427.20	3,599.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,997.38	7,572.84

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	120,000.00
负债合计		201,560.65	149,168.28
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	22,058,261.00	22,058,261.00
未分配利润	7.4.7.10	18,598,026.93	18,259,954.27
所有者权益合计		40,656,287.93	40,318,215.27
负债和所有者权益总计		40,857,848.58	40,467,383.55

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.843 元，基金份额总额 22,058,261.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中证 500 沪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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-1,353,893.48	-8,284,789.38
1.利息收入		4,150.21	5,188.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,146.22	5,188.92
债券利息收入		3.99	-
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）		-3,946,509.35	-3,368,351.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,332,591.53	-3,689,696.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	492.01	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	385,590.17	321,345.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,594,567.82	-4,922,469.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-6,102.16	843.00
减：二、费用		728,997.80	623,709.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	215,420.58	212,606.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	43,084.13	42,521.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	40,208.09	32,317.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	430,285.00	336,265.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,082,891.28	-8,908,499.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,082,891.28	-8,908,499.31

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 沪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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	22,058,261.00	18,259,954.27	40,318,215.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,082,891.28	-2,082,891.28
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）	-	2,420,963.94	2,420,963.94
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	12,269,286.90	26,269,286.90
2.基金赎回款	-14,000,000.00	-9,848,322.96	-23,848,322.96
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）	22,058,261.00	18,598,026.93	40,656,287.93

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	24,058,261.00	29,055,002.00	53,113,263.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,908,499.31	-8,908,499.31
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）	-2,000,000.00	-1,886,548.42	-3,886,548.42
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	1,862,675.50	4,862,675.50
2. 基金赎回款	-5,000,000.00	-3,749,223.92	-8,749,223.92
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）	22,058,261.00	18,259,954.27	40,318,215.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2012】851 号文“关于核准中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复”的核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为发起人于 2012 年 7 月 30 日至 2012 年 8 月 17 日向社会公开募集, 募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60469430_H02 号验资报告后, 向中国证监会报送基金

备案材料。基金合同于 2012 年 8 月 24 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。

设立时，中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 491,716,000.00 元，折合 491,716,000.00 份基金份额；有效认购资金在划入基金募集专户前产生的利息为人民币 22,800.00 元，折合 22,800.00 份基金份额；以上收到的资金共计人民币 491,738,800.00 元，折合 491,738,800.00 份基金份额。中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金募集的由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司划转至账号为 D890799184 的中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金证券账户的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币 49,319,461.00 元，折合 49,319,461.00 份基金份额。上述两部分合计折算成基金份额为 541,058,261.00 份。与其投入的实收基金相关的资产总额为人民币 541,058,261.00 元，其中现金人民币 491,738,800.00 元，股票人民币 49,319,461.00 元。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。（以下简称“中国银行”）

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证字[2012]67 号文审核同意，本基金于 2012 年 10 月 8 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 沪市指数。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，该部分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。本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%，年跟踪误差不得超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 沪市指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基

金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、衍生工具等。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和

其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同

时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率计算，当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配采用现金方式；

(2) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(6) 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 11 月 27 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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；存款利息收入不征收增值税。

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（以下简称“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，资管产品管理人未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的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

股分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 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，暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	456,065.87	314,298.90
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	456,065.87	314,298.90

注：本基金于本会计期间及上年度可比期间未投资于定期存款或其他存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,412,769.04	40,401,447.84	-3,011,321.20
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	43,412,769.04	40,401,447.84	-3,011,321.20
项目	上年度末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,754,461.61	40,148,572.59	-5,605,889.02
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	45,754,461.61	40,148,572.59	-5,605,889.02

注：1、本报告期本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

2、此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	98.97	63.57
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	-	1.91
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	0.10	0.10
合计	99.07	65.58

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	10,997.38	7,572.84
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	10,997.38	7,572.84

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 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	50,000.00
预提费用	-	-
预提审计费	20,000.00	20,000.00
信息披露费	100,000.00	50,000.00
可退替代款	-	-
合计	170,000.00	120,000.00

注：1、应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,058,261.00	22,058,261.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-14,000,000.00	-14,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	22,058,261.00	22,058,261.00

7.4.7.10 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	16,023,482.35	2,236,471.92	18,259,954.27
本期利润	-4,677,459.10	2,594,567.82	-2,082,891.28
本期基金份额交易产生的变动数	77,722.66	2,343,241.28	2,420,963.94

其中：基金申购款	10,194,615.24	2,074,671.66	12,269,286.90
基金赎回款	-10,116,892.58	268,569.62	-9,848,322.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,423,745.91	7,174,281.02	18,598,026.93

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	3,962.48	4,973.95
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	175.34	179.78
其他	8.40	35.19
合计	4,146.22	5,188.92

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-253,890.41	-1,723,601.04
股票投资收益——赎回差价收入	-4,078,701.12	-1,966,095.88
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-4,332,591.53	-3,689,696.92

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	12,885,087.17	10,704,115.02
减：卖出股票成本总额	13,138,977.58	12,427,716.06
买卖股票差价收入	-253,890.41	-1,723,601.04

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
赎回基金份额对价总额	23,848,322.96	8,749,223.92
减：现金支付赎回款总额	830,320.96	97,869.92
减：赎回股票成本总额	27,096,703.12	10,617,449.88
赎回差价收入	-4,078,701.12	-1,966,095.88

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	33,496.00	-
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	33,000.00	-
减：应收利息总额	3.99	-
买卖债券差价收入	492.01	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
股票投资产生的股利收益	385,590.17	321,345.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	385,590.17	321,345.04

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,594,567.82	-4,922,469.42
——股票投资	2,594,567.82	-4,922,469.42
——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	2,594,567.82	-4,922,469.42

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-6,102.16	843.00
合计	-6,102.16	843.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	40,208.09	32,317.11
银行间市场交易费用	-	-
合计	40,208.09	32,317.11

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	150,000.00	50,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	285.00	265.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
债券托管帐户维护费	-	6,000.00
其他	-	-
合计	430,285.00	336,265.00

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。

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东

中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：(1) 根据本基金管理人大成基金董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券将所持大成基金 2% 股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。大成基金原股东广东证券股份有限公司自 2016 年 4 月 25 日起不再为本基金关联方。

(2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	22,444,919.42	82.15%	-	0.00%

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	24,664.40	73.63%	-	0.00%

7.4.10.1.3 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12月31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	20,454.55	82.15%	10,997.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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
-	-	0.00	-	0.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	215,420.58	212,606.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

(2) 于 2017 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 17,136.07 元（2016 年 12 月 31 日：人民币 17,996.18 元）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	43,084.13	42,521.35

注：(1)基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按基金财产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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

(2)于 2017 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 3,427.20 元（2016 年 12 月 31 日：人民币 3,599.26 元）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2012 年 8 月 24 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占基金总份额比例	77.0700%	77.0700%

注：基金管理人申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行股份有限公司	456,065.87	3,962.48	314,298.90	4,973.95
------------	------------	----------	------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行同业利率及相关协议利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603161	科华控股	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,000	16,750.00	16,750.00	-

7.4.12.2 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
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	临时停牌	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	28,398	437,901.91	448,404.42	-
600614	鹏起科技	2017 年 12 月 26 日	临时停牌	10.16	-	-	22,870	292,408.35	232,359.20	-

600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	临时停牌	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	32,900	263,531.02	191,149.00	-
600645	中源协和	2017 年 10 月 9 日	临时停牌	28.40	2018 年 1 月 19 日	25.56	6,720	246,493.28	190,848.00	-
600187	国中水务	2017 年 11 月 10 日	临时停牌	4.68	2018 年 3 月 20 日	4.21	28,600	185,289.77	133,848.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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 沪市指数为原则，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。

7.4.13.2 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，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。本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。本基金持有的生息资产主要为银行存款。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交易形成负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	456,065.87	-	-	-	456,065.87
存出保证金	235.80	-	-	-	235.80
交易性金融资产	-	-	-	40,401,447.84	40,401,447.84
应收利息	-	-	-	99.07	99.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	456,301.67	-	-	40,401,546.91	40,857,848.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,136.07	17,136.07
应付托管费	-	-	-	3,427.20	3,427.20
应付交易费用	-	-	-	10,997.38	10,997.38
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	201,560.65	201,560.65
利率敏感度缺口	456,301.67	-	-	-40,199,986.26	40,656,287.93
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	314,298.90	-	-	-	314,298.90
结算备付金	4,151.86	-	-	-	4,151.86
存出保证金	294.62	-	-	-	294.62
交易性金融资产	-	-	-	40,148,572.59	40,148,572.59
应收利息	-	-	-	65.58	65.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	318,745.38	-	-	40,148,638.17	40,467,383.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,996.18	17,996.18
应付托管费	-	-	-	3,599.26	3,599.26
应付交易费用	-	-	-	7,572.84	7,572.84
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	149,168.28	149,168.28
利率敏感度缺口	318,745.38	-	-	-39,999,469.89	40,318,215.27

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数型证券投资基金，于本报告期末及上年度末，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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	40,401,447.84	99.37	40,148,572.59	99.58
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	40,401,447.84	99.37	40,148,572.59	99.58

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	中证 500 沪市指数上升 5%	2,018,937.04	1,991,858.91
	中证 500 沪市指数下降 5%	-2,018,937.04	-1,991,858.91

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。该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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 39,188,089.22，划分为第二层次的余额为人民币 1,213,358.62 元，无划分为第三层次余额。（于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 37,527,424.45 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,621,148.14 元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2017)6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(以下简称“估值业务指引”),自2017年11月27日起,本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日,本基金的资产净值为人民币40,656,287.93元,已连续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,向中国证监会说明原因和报送解决方案。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月30日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	40,401,447.84	98.88
	其中：股票	40,401,447.84	98.88
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	456,065.87	1.12
	-	-	0.00
8	其他各项资产	334.87	0.00
9	合计	40,857,848.58	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值，8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	301,386.00	0.74
B	采矿业	1,928,876.88	4.74
C	制造业	23,899,862.04	58.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,365,399.49	3.36
E	建筑业	520,380.72	1.28
F	批发和零售业	2,760,086.85	6.79
G	交通运输、仓储和邮政业	2,629,615.04	6.47
H	住宿和餐饮业	113,015.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,554,211.86	3.82

J	金融业	911,338.40	2.24
K	房地产业	2,759,838.08	6.79
L	租赁和商务服务业	364,567.43	0.90
M	科学研究和技术服务业	190,848.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	328,017.20	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	107,946.00	0.27
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	522,624.45	1.29
S	综合	126,684.40	0.31
	合计	40,384,697.84	99.33

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	16,750.00	0.04
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	-	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	16,750.00	0.04

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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	600516	方大炭素	23,000	664,240.00	1.63
2	600201	生物股份	19,320	613,216.80	1.51
3	600176	中国巨石	37,565	611,933.85	1.51
4	600525	长园集团	28,398	448,404.42	1.10
5	600584	长电科技	20,252	431,975.16	1.06
6	600438	通威股份	33,300	403,263.00	0.99
7	600521	华海药业	13,337	401,710.44	0.99
8	603019	中科曙光	9,700	390,328.00	0.96
9	600426	华鲁恒升	24,173	384,834.16	0.95
10	600315	上海家化	10,060	371,113.40	0.91
11	600079	人福医药	20,300	362,152.00	0.89
12	600298	安琪酵母	10,630	347,813.60	0.86
13	600642	申能股份	58,200	341,052.00	0.84
14	600256	广汇能源	67,100	339,526.00	0.84
15	601168	西部矿业	40,600	332,920.00	0.82
16	600291	西水股份	14,100	331,632.00	0.82
17	600392	盛和资源	17,410	330,790.00	0.81
18	600004	白云机场	22,200	326,340.00	0.80
19	600879	航天电子	40,742	319,417.28	0.79
20	601233	桐昆股份	14,000	314,860.00	0.77
21	600388	龙净环保	18,200	314,860.00	0.77
22	600022	山东钢铁	140,530	300,734.20	0.74
23	600499	科达洁能	27,000	299,430.00	0.74
24	600600	青岛啤酒	7,500	294,975.00	0.73
25	603589	口子窖	6,400	294,720.00	0.72
26	600872	中炬高新	11,895	294,520.20	0.72
27	600811	东方集团	63,670	291,608.60	0.72
28	601699	潞安环能	25,500	290,190.00	0.71

29	600875	东方电气	25,700	288,611.00	0.71
30	600885	宏发股份	6,900	285,453.00	0.70
31	600056	中国医药	11,408	283,945.12	0.70
32	600166	福田汽车	99,400	279,314.00	0.69
33	600718	东软集团	18,700	274,142.00	0.67
34	600839	四川长虹	78,600	273,528.00	0.67
35	600643	爱建集团	24,505	271,515.40	0.67
36	600755	厦门国贸	26,703	269,700.30	0.66
37	600418	江淮汽车	28,400	268,664.00	0.66
38	600183	生益科技	15,545	268,306.70	0.66
39	600325	华发股份	36,350	267,536.00	0.66
40	600260	凯乐科技	9,049	263,416.39	0.65
41	600266	北京城建	20,000	262,800.00	0.65
42	600808	马钢股份	63,500	262,255.00	0.65
43	600138	中青旅	12,389	258,558.43	0.64
44	600787	中储股份	23,416	257,576.00	0.63
45	600060	海信电器	16,800	252,336.00	0.62
46	600673	东阳光科	36,794	248,359.50	0.61
47	600460	士兰微	16,000	246,880.00	0.61
48	600160	巨化股份	22,600	240,238.00	0.59
49	603444	吉比特	1,300	239,109.00	0.59
50	600094	大名城	34,200	239,058.00	0.59
51	600435	北方导航	19,200	236,736.00	0.58
52	600614	鹏起科技	22,870	232,359.20	0.57
53	600884	杉杉股份	11,970	231,978.60	0.57
54	600978	宜华生活	25,327	231,488.78	0.57
55	600655	豫园股份	21,400	229,836.00	0.57
56	600062	华润双鹤	9,280	229,680.00	0.56
57	601000	唐山港	48,570	228,764.70	0.56
58	600282	南钢股份	47,200	228,448.00	0.56
59	600143	金发科技	34,700	227,979.00	0.56
60	600179	安通控股	9,100	225,225.00	0.55
61	600346	恒力股份	18,200	224,406.00	0.55
62	600503	华丽家族	34,100	223,355.00	0.55
63	600970	中材国际	22,450	222,030.50	0.55
64	601231	环旭电子	13,900	219,203.00	0.54
65	600409	三友化工	22,075	211,699.25	0.52
66	600125	铁龙物流	19,500	210,990.00	0.52
67	600240	华业资本	24,480	210,038.40	0.52

68	600161	天坛生物	7,215	207,719.85	0.51
69	600597	光明乳业	13,100	198,465.00	0.49
70	600566	济川药业	5,200	198,380.00	0.49
71	600410	华胜天成	18,770	197,460.40	0.49
72	600635	大众公用	41,179	196,835.62	0.48
73	600037	歌华有线	15,000	194,850.00	0.48
74	600664	哈药股份	32,900	191,149.00	0.47
75	600122	宏图高科	19,700	190,893.00	0.47
76	600645	中源协和	6,720	190,848.00	0.47
77	600307	酒钢宏兴	66,600	190,476.00	0.47
78	600572	康恩贝	26,810	189,546.70	0.47
79	601200	上海环境	7,600	189,544.00	0.47
80	600348	阳泉煤业	25,600	188,928.00	0.46
81	600500	中化国际	22,200	187,812.00	0.46
82	600267	海正药业	12,400	187,736.00	0.46
83	600380	健康元	16,769	187,645.11	0.46
84	600171	上海贝岭	11,503	187,153.81	0.46
85	600717	天津港	17,800	186,722.00	0.46
86	600863	内蒙华电	61,900	183,843.00	0.45
87	601880	大连港	65,830	183,665.70	0.45
88	600881	亚泰集团	34,600	182,688.00	0.45
89	600511	国药股份	6,544	181,923.20	0.45
90	600120	浙江东方	7,300	179,653.00	0.44
91	600026	中远海能	29,157	178,440.84	0.44
92	600416	湘电股份	14,190	177,233.10	0.44
93	600737	中粮糖业	22,000	174,900.00	0.43
94	600967	内蒙一机	14,400	173,520.00	0.43
95	600936	广西广电	25,100	172,186.00	0.42
96	600466	蓝光发展	18,200	170,170.00	0.42
97	600835	上海机电	6,894	168,903.00	0.42
98	600633	浙数文化	11,100	168,720.00	0.41
99	600575	皖江物流	41,600	168,480.00	0.41
100	603369	今世缘	10,800	167,508.00	0.41
101	600751	天海投资	27,400	167,414.00	0.41
102	600216	浙江医药	12,400	166,656.00	0.41
103	600598	北大荒	15,300	164,934.00	0.41
104	600151	航天机电	21,601	163,951.59	0.40
105	600064	南京高科	11,546	163,837.74	0.40
106	600478	科力远	22,125	163,282.50	0.40

107	600823	世茂股份	32,200	159,068.00	0.39
108	603766	隆鑫通用	22,500	157,950.00	0.39
109	600039	四川路桥	38,436	156,434.52	0.38
110	600908	无锡银行	19,800	155,826.00	0.38
111	600086	东方金钰	14,378	153,125.70	0.38
112	600017	日照港	39,238	152,243.44	0.37
113	603077	和邦生物	75,665	151,330.00	0.37
114	600648	外高桥	8,100	149,850.00	0.37
115	600158	中体产业	14,401	148,042.28	0.36
116	600563	法拉电子	2,903	147,501.43	0.36
117	600801	华新水泥	10,428	147,347.64	0.36
118	600366	宁波韵升	8,319	145,748.88	0.36
119	600312	平高电气	14,531	145,164.69	0.36
120	600848	上海临港	6,500	144,950.00	0.36
121	601678	滨化股份	17,738	144,032.56	0.35
122	600317	营口港	41,600	141,024.00	0.35
123	600393	粤泰股份	21,800	138,212.00	0.34
124	600594	益佰制药	13,500	137,970.00	0.34
125	600108	亚盛集团	33,200	136,452.00	0.34
126	600651	飞乐音响	14,815	135,557.25	0.33
127	600270	外运发展	7,804	134,853.12	0.33
128	600859	王府井	6,610	134,844.00	0.33
129	600545	卓郎智能	12,266	134,680.68	0.33
130	600187	国中水务	28,600	133,848.00	0.33
131	600993	马应龙	6,510	133,324.80	0.33
132	600611	大众交通	26,650	132,717.00	0.33
133	600729	重庆百货	5,286	132,467.16	0.33
134	601928	凤凰传媒	16,300	132,193.00	0.33
135	600169	太原重工	38,200	132,172.00	0.33
136	600316	洪都航空	9,200	130,272.00	0.32
137	600259	广晟有色	3,300	129,657.00	0.32
138	600694	大商股份	3,800	128,174.00	0.32
139	603000	人民网	11,800	127,794.00	0.31
140	600141	兴发集团	7,500	126,750.00	0.31
141	600770	综艺股份	16,669	126,684.40	0.31
142	601717	郑煤机	19,200	126,336.00	0.31
143	600557	康缘药业	9,243	124,595.64	0.31
144	600565	迪马股份	31,000	124,000.00	0.30
145	600098	广州发展	17,500	123,725.00	0.30

146	603188	亚邦股份	7,400	122,766.00	0.30
147	600582	天地科技	26,400	122,760.00	0.30
148	600874	创业环保	9,287	120,823.87	0.30
149	601311	骆驼股份	9,093	120,482.25	0.30
150	600765	中航重机	9,990	120,079.80	0.30
151	603883	老百姓	1,900	119,681.00	0.29
152	600587	新华医疗	6,984	117,261.36	0.29
153	601016	节能风电	35,600	117,124.00	0.29
154	600338	西藏珠峰	2,800	116,620.00	0.29
155	601689	拓普集团	4,700	116,278.00	0.29
156	600155	宝硕股份	11,200	114,576.00	0.28
157	600073	上海梅林	14,060	114,167.20	0.28
158	600754	锦江股份	3,500	113,015.00	0.28
159	600277	亿利洁能	17,500	112,700.00	0.28
160	600687	刚泰控股	9,500	112,195.00	0.28
161	603816	顾家家居	1,900	112,043.00	0.28
162	600971	恒源煤电	10,700	111,601.00	0.27
163	600058	五矿发展	9,200	111,136.00	0.27
164	600284	浦东建设	11,829	110,009.70	0.27
165	600580	卧龙电气	13,728	109,961.28	0.27
166	600869	智慧能源	19,108	109,679.92	0.27
167	600773	西藏城投	9,378	109,535.04	0.27
168	600300	维维股份	25,000	109,250.00	0.27
169	601002	晋亿实业	10,108	108,458.84	0.27
170	600422	昆药集团	11,800	107,970.00	0.27
171	603377	东方时尚	2,700	107,946.00	0.27
172	601001	大同煤业	17,800	107,690.00	0.26
173	603515	欧普照明	2,500	107,100.00	0.26
174	600578	京能电力	28,900	106,930.00	0.26
175	600536	中国软件	6,400	105,920.00	0.26
176	600458	时代新材	10,337	104,093.59	0.26
177	600623	华谊集团	12,100	103,213.00	0.25
178	600759	洲际油气	24,138	102,827.88	0.25
179	600428	中远海特	18,284	102,573.24	0.25
180	601777	力帆股份	14,052	102,017.52	0.25
181	600006	东风汽车	17,128	100,198.80	0.25
182	600750	江中药业	3,898	99,321.04	0.24
183	600335	国机汽车	8,832	99,271.68	0.24
184	603868	飞科电器	1,300	98,475.00	0.24

185	600395	盘江股份	14,200	97,554.00	0.24
186	600059	古越龙山	10,360	97,280.40	0.24
187	600280	中央商场	12,300	96,801.00	0.24
188	600289	ST 信通	9,659	96,010.46	0.24
189	603658	安图生物	1,800	95,796.00	0.24
190	600517	置信电气	14,521	93,950.87	0.23
191	600639	浦东金桥	5,475	92,801.25	0.23
192	603328	依顿电子	6,400	91,840.00	0.23
193	603198	迎驾贡酒	5,200	91,468.00	0.22
194	603556	海兴电力	2,500	91,000.00	0.22
195	600329	中新药业	6,101	90,721.87	0.22
196	600195	中牧股份	4,602	90,705.42	0.22
197	600657	信达地产	16,200	90,396.00	0.22
198	600757	长江传媒	12,971	90,148.45	0.22
199	603355	莱克电气	1,800	88,704.00	0.22
200	600862	中航高科	8,900	86,152.00	0.21
201	600894	广日股份	9,200	86,020.00	0.21
202	600880	博瑞传播	16,300	85,901.00	0.21
203	600628	新世界	8,281	84,217.77	0.21
204	603888	新华网	3,400	80,410.00	0.20
205	600184	光电股份	4,373	80,113.36	0.20
206	601127	小康股份	3,900	78,429.00	0.19
207	600748	上实发展	11,803	75,657.23	0.19
208	600292	远达环保	8,416	75,323.20	0.19
209	600640	号百控股	5,100	74,562.00	0.18
210	600776	东方通信	10,202	73,760.46	0.18
211	600743	华远地产	20,079	73,489.14	0.18
212	603228	景旺电子	1,300	69,901.00	0.17
213	601020	华钰矿业	3,400	69,768.00	0.17
214	600481	双良节能	17,314	69,429.14	0.17
215	600053	九鼎投资	2,800	66,892.00	0.16
216	600996	贵广网络	6,700	66,330.00	0.16
217	603568	伟明环保	3,000	63,150.00	0.16
218	603806	福斯特	1,800	61,380.00	0.15
219	603225	新凤鸣	1,700	60,860.00	0.15
220	600826	兰生股份	4,502	59,291.34	0.15
221	600126	杭钢股份	8,400	57,708.00	0.14
222	603169	兰石重装	6,600	55,374.00	0.14
223	600618	氯碱化工	4,800	51,984.00	0.13

224	603001	奥康国际	3,442	49,805.74	0.12
225	603528	多伦科技	5,400	47,682.00	0.12
226	601811	新华文轩	3,400	45,662.00	0.11
227	601969	海南矿业	4,700	41,595.00	0.10
228	600917	重庆燃气	3,700	41,218.00	0.10
229	603025	大豪科技	1,300	38,246.00	0.09
230	601128	常熟银行	5,300	37,789.00	0.09
231	603877	太平鸟	1,300	35,243.00	0.09
232	600939	重庆建工	4,300	31,906.00	0.08
233	603569	长久物流	1,300	31,447.00	0.08

8.3.2 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	603161	科华控股	1,000	16,750.00	0.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603444	吉比特	370,610.00	0.92
2	600642	申能股份	369,606.00	0.92
3	600438	通威股份	363,731.00	0.90
4	600256	广汇能源	330,964.00	0.82
5	600004	白云机场	312,446.00	0.77
6	600885	宏发股份	297,993.00	0.74
7	600718	东软集团	290,048.00	0.72
8	603799	华友钴业	283,754.76	0.70
9	600839	四川长虹	281,474.00	0.70
10	600875	东方电气	272,620.00	0.68

11	600060	海信电器	240,532.00	0.60
12	601000	唐山港	231,242.00	0.57
13	600346	恒力股份	225,768.00	0.56
14	600179	安通控股	224,239.00	0.56
15	600037	歌华有线	204,569.00	0.51
16	600566	济川药业	202,614.00	0.50
17	600575	皖江物流	201,530.00	0.50
18	600936	广西广电	182,937.00	0.45
19	601200	上海环境	182,621.00	0.45
20	600388	龙净环保	182,023.00	0.45

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。

8.4.2 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	601012	隆基股份	913,118.00	2.26
2	600487	亨通光电	804,352.60	2.00
3	603799	华友钴业	546,995.00	1.36
4	600522	中天科技	483,738.80	1.20
5	600219	南山铝业	445,931.00	1.11
6	600682	南京新百	428,796.00	1.06
7	600436	片仔癀	385,583.00	0.96
8	600809	山西汾酒	323,584.00	0.80
9	600699	均胜电子	322,099.00	0.80
10	600528	中铁工业	232,274.00	0.58
11	600497	驰宏锌锗	224,782.00	0.56
12	600549	厦门钨业	212,319.00	0.53
13	600198	大唐电信	181,346.00	0.45
14	600601	方正科技	179,715.00	0.45
15	600067	冠城大通	157,800.20	0.39
16	600720	祁连山	150,271.20	0.37
17	600575	皖江物流	148,112.90	0.37
18	601929	吉视传媒	146,045.00	0.36
19	600200	江苏吴中	143,305.00	0.36
20	600851	海欣股份	139,856.12	0.35

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。

8.4.3 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	14,551,029.33
卖出股票收入（成交）总额	12,885,087.17

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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，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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	235.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	99.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	334.87

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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	600525	长园集团	448,404.42	1.10	临时停牌

8.12.5.2 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	603161	科华控股	16,750.00	0.04	新股锁定

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
294	75,028.10	19,083,818.00	86.52%	2,974,443.00	13.48%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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	77.07%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	9.07%
3	钱中明	369,444.00	1.67%
4	广州国资产业发展股权投资基金合 伙企业（有限合伙）	196,332.00	0.89%
5	高翔	94,600.00	0.43%
6	贺顺龙	90,000.00	0.41%
7	中国银河证券股份有限公司	83,318.00	0.38%
8	张春雁	72,900.00	0.33%
9	王焕永	68,400.00	0.31%
10	吴炳芬	67,253.00	0.30%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	-	0.0000%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：0；

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：0。

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 8 月 24 日）基金份额总额	541,058,261.00
本报告期期初基金份额总额	22,058,261.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	22,058,261.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

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。

3、基金管理人于 2017 年 8 月 12 日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自 2017 年 8 月 11 日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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)，本报告期应支付的审计费用为 2 万元整。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、报告期内公司收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改行政监管措施的决定》，责令公司在三个月内对货币基金单一持有人持有比例过高的情况进行整改，并对相关责任人采取行政监管措施。截止目前，公司已经制定并落实相关整改措施，并向深圳证监局提交整改报告。

2、报告期内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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
光大证券		222,444,919.42	82.15%	20,454.55	82.15%	-
广发证券	1	4,076,560.56	14.92%	3,715.10	14.92%	-
招商证券	2	799,798.45	2.93%	728.86	2.93%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投证	1	-	0.00%	-	0.00%	-

券						
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	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：渤海证券、中投证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	24,664.40	73.63%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	8,831.60	26.37%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

11.8 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证券投资基金及专户等资管产品实施增值税政策的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 12 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁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 12 月 12 日

3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承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 12 月 8 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 11 月 27 日
5	关于大成基金网上直销端建设银行进行系统维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 11 月 3 日
6	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 10 月 27 日
7	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 10 月 12 日
8	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 10 月 9 日
9	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年 2 期）摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 10 月 9 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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 9 月 13 日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄金融控股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 9 月 4 日
12	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统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 9 月 1 日
13	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 24 日
14	大成基金管理有限公司关于网上直销货币基金快速赎回业务调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 15 日
15	大成基金管理有限公司督察长任职公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 12 日
16	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加中原银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 4 日
17	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 7 月 19 日
18	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 7 月 7 日

19	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问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 7 月 7 日
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
27	中证 500 沪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
28	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
29	中证 500 沪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 7 日
30	中证 500 沪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）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 7 日
31	中证 500 沪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
32	中证 500 沪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
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调整网上直销系统招行直联渠道基金	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日

	交易费率优惠的公告		
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（杜鹏）	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	中证 500 沪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
40	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
41	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
42	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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170417-20170521	0.00	14,251,632.00	14,055,300.00	196,332.00	0.89%
	2	20170101-20171231	17,000,000.00	0.00	0.00	17,000,000.00	77.07%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 沪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。

13.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日