

大成深证成份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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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 其他指标.....	10
3.4 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.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§ 6 审计报告	19

6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§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.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	72
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.5 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.....	74
§10 开放式基金份额变动.....	76
§11 重大事件揭示.....	77
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8 其他重大事件.....	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
§13 备查文件目录.....	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	86
13.3 查阅方式.....	86

§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	28,735,342.00 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	赵冰	贺倩
	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通 合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天 地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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 6 月 5 日 (基金合同生效日)- 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-29,207,329.77	-38,511,531.27	-406,999,068.76
本期利润	36,253,774.69	-135,511,031.26	-393,853,788.97
加权平均基金份额本期利润	1.0521	-2.7057	-1.1359
本期加权平均净值利润率	9.46%	-24.85%	-32.31%
本期基金份额净值增长率	9.67%	-18.69%	-13.75%
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	-153,557,130.35	-186,039,686.78	-220,806,172.35
期末可供分配基金份额利润	-5.3438	-4.5670	-3.7981
期末基金资产净值	336,629,678.33	435,153,307.18	763,719,894.04
期末基金份额净值	11.715	10.682	13.137
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	-23.09%	-29.87%	-13.75%

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）。

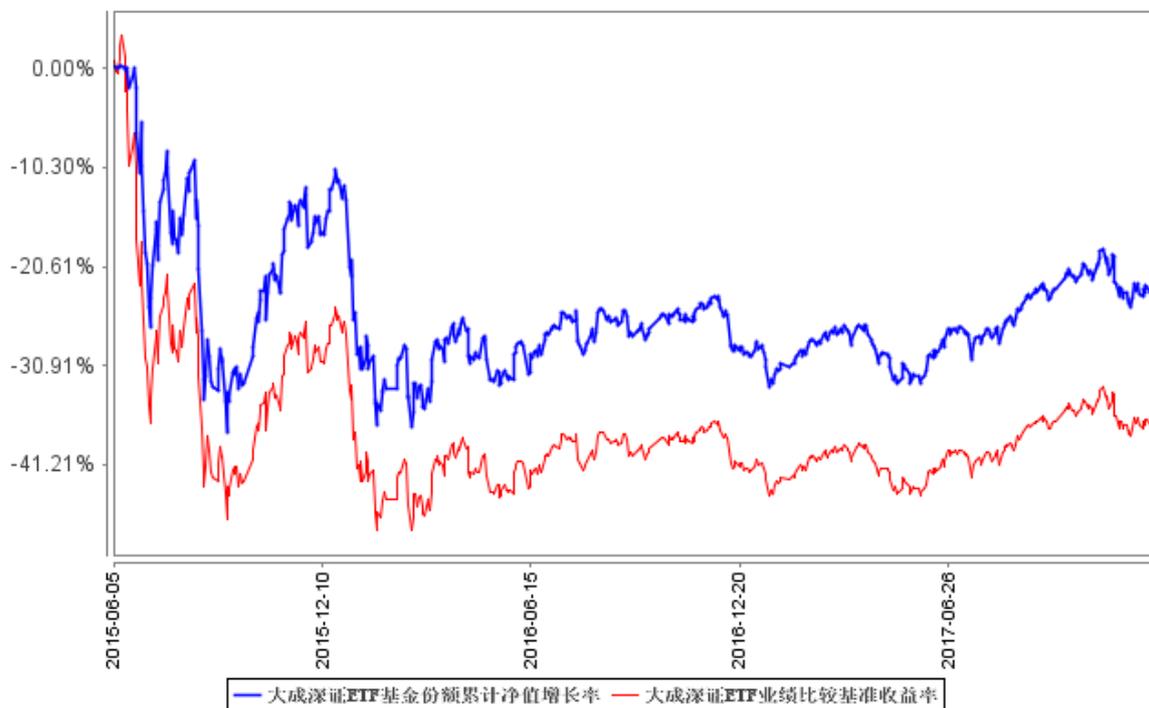
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

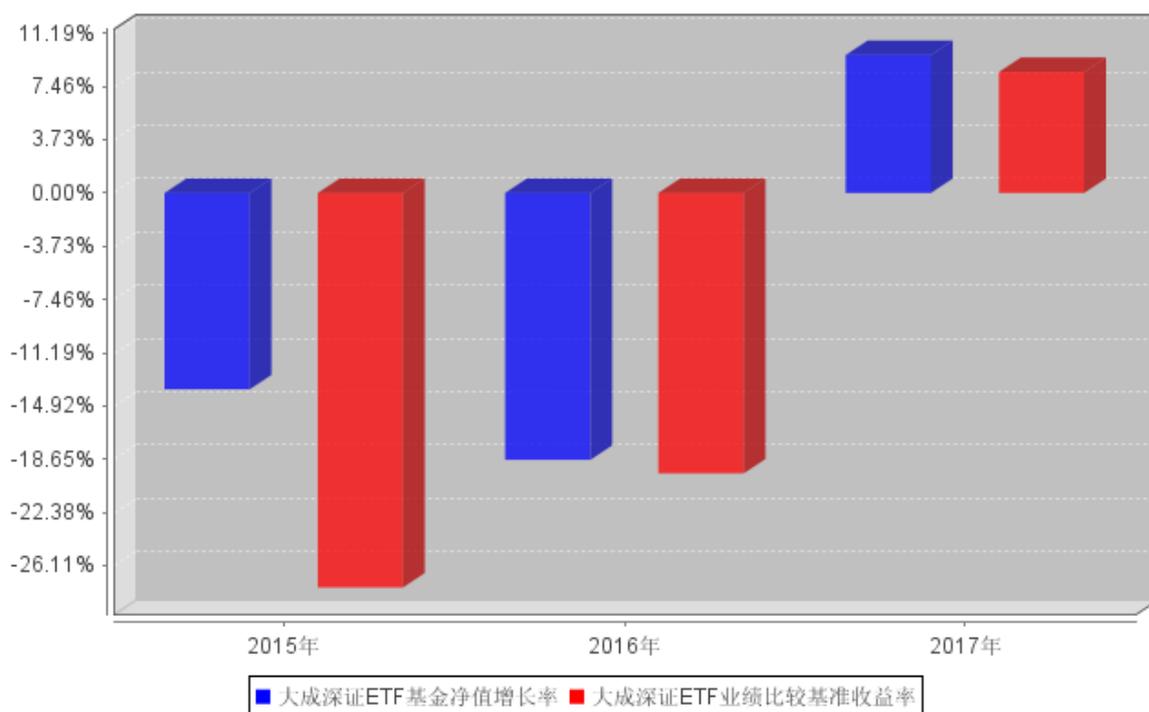
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.17%	0.98%	-0.42%	0.99%	0.25%	-0.01%
过去六个月	5.59%	0.89%	4.85%	0.90%	0.74%	-0.01%
过去一年	9.67%	0.86%	8.48%	0.87%	1.19%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-23.09%	1.82%	-36.92%	1.91%	13.83%	-0.09%

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 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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	2015年6月5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

					<p>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>
刘淼女士	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	9 年	<p>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</p>

					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
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	经济学硕士，中国注册会计师。2008年1月至2008年12月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008年12月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师、数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015年7月20日至2017年7月3日担任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、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 年大盘蓝筹股表现明显优于中小盘股，上证 50、沪深 300 分别上涨 25.08%、21.78%，中小盘代表指数中证 1000、创业板分别下跌 17.35%、10.67%。剔除当年上市的新股后 3029 只 A 股中，仅 698 只上涨，涨跌幅中位数为-20.7%，结构化行情明显。行业表现上，食品饮料、家电、金融等价值蓝筹股和受供给侧利好推动的钢铁股大幅上涨，计算机、传媒、国防军工等估值高且题材股较多的行业跌幅较大。

2017 年前三季度，中国实际 GDP 增速分别为 6.9%、6.9%和 6.8%，比 2016 年的 6.7%小幅改善。受益于供给侧改革去产能，工业品价格大幅上涨，全年 PPI 涨幅超过 6%，远高于 2016 年的 -1.4%，带动工业企业利润增速大幅回升。货币政策方面，2017 是严监管年，监管层在保持货币供给稳定、不发生系统性金融风险的前提下严控金融杠杆，对表外理财、同业业务等多次发文整顿，货币政策边际收紧，国债收益率持续走高。在宏观经济向好，货币政策收紧的环境下，投资

者风险偏好明显下降，蓝筹白马股受到市场追捧。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 11.715 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.67%，业绩比较基准收益率为 8.48%。

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 2018 年，外需回暖有利于国内经济平稳复苏，但受调控政策和货币政策影响较大的房地产和基建投资增速仍有待观察。货币政策难现松动，金融去杠杆仍是监管工作重心。经过 2017 年的极度分化行情，部分大蓝筹白马股估值已经泡沫化，而一些成长个股经过一年的调整已达到可布局估值水平。

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数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、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括三名投资组合经理。

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人

已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成深证成份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	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“大成深证 ETF”)的财务报表, 包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表, 2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了大成深证 ETF 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于大成深证 ETF, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>大成深证 ETF 的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 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, 基金管理人管理层负责评估大成深证 ETF 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算大成深证 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成深证 ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表	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

表审计的责任	<p>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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能导致对大成深证 ETF 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大成深证 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 俞伟敏

会计师事务所的地址	中国 · 上海市
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：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 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	3,888,932.20	4,117,850.66
结算备付金		3,635.23	4,794.28
存出保证金		3,108.73	13,736.64
交易性金融资产	7.4.7.2	333,415,965.87	431,449,359.25
其中：股票投资		333,087,565.87	431,449,359.25
基金投资		-	-
债券投资		328,400.00	-
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	837.78	842.50
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		337,312,479.81	435,586,583.33
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		190,599.33	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		143,868.13	190,230.13
应付托管费		28,773.62	38,046.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,560.40	-
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	315,000.00	205,000.00
负债合计		682,801.48	433,276.15
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	437,741,105.78	620,543,637.48
未分配利润	7.4.7.10	-101,111,427.45	-185,390,330.30
所有者权益合计		336,629,678.33	435,153,307.18
负债和所有者权益总计		337,312,479.81	435,586,583.33

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 11.715 元，基金份额总额

28,735,342.00 份。

7.2 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 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		39,412,429.50	-131,411,942.11
1.利息收入		30,363.36	46,570.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	30,301.23	46,531.34
债券利息收入		62.13	39.16
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）		-26,079,038.32	-34,459,012.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-30,240,058.95	-40,190,412.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,028.77	27,024.83
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	4,151,991.86	5,704,374.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	65,461,104.46	-96,999,499.99
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	-	-
减：二、费用		3,158,654.81	4,099,089.15

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,919,338.25	2,733,729.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	383,867.78	546,745.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	229,973.78	243,113.74
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	625,475.00	575,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,253,774.69	-135,511,031.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,253,774.69	-135,511,031.26

7.3 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 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）	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）	-	36,253,774.69	36,253,774.69
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）	-182,802,531.70	48,025,128.16	-134,777,403.54
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-182,802,531.70	48,025,128.16	-134,777,403.54
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）	437,741,105.78	-101,111,427.45	336,629,678.33
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)	885,607,308.57	-121,887,414.53	763,719,894.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-135,511,031.26	-135,511,031.26
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)	-265,063,671.09	72,008,115.49	-193,055,555.60
其中：1. 基金申购款	4,570,063.29	-1,134,612.56	3,435,450.73
2. 基金赎回款	-269,633,734.38	73,142,728.05	-196,491,006.33
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)	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18

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

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2015]450号《关于核准大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,384,454,750.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第634号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2015年6月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

2,384,588,069.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 133,319.00 元基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]330 号文审核同意，本基金于 2015 年 7 月 8 日在深交所挂牌交易。

根据《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2015 年 6 月 29 日进行了基金份额折算，折算比例为 1: 0.06565125，并于 2015 年 6 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报；主要投资范围为标的指数的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 95%；本基金可少量投资于债券(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)。在正常市场情况下，本基金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%。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2018 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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在费用涵盖期间按基金合同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法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,888,932.20	4,117,850.66
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,888,932.20	4,117,850.66

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	351,480,681.61	333,087,565.87	-18,393,115.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	328,400.00	328,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	328,400.00	328,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	351,809,081.61	333,415,965.87	-18,393,115.74
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	515,303,579.45	431,449,359.25	-83,854,220.20
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	515,303,579.45	431,449,359.25	-83,854,220.20	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

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	799.77	834.10
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	1.60	2.20
应收债券利息	35.01	-
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	1.40	6.20
合计	837.78	842.50

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	4,560.40	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,560.40	-

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
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	265,000.00	155,000.00
合计	315,000.00	205,000.00

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	40,735,342.00	620,543,637.48
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-12,000,000.00	-182,802,531.70
本期末	28,735,342.00	437,741,105.78

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	-186,039,686.78	649,356.48	-185,390,330.30
本期利润	-29,207,329.77	65,461,104.46	36,253,774.69
本期基金份额交易产生的变动数	61,689,886.20	-13,664,758.04	48,025,128.16
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	61,689,886.20	-13,664,758.04	48,025,128.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-153,557,130.35	52,445,702.90	-101,111,427.45

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	29,218.41	43,656.74

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	1,014.22	1,782.73
其他	68.60	1,091.87
合计	30,301.23	46,531.34

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	-19,074,718.22	-10,424,253.16
股票投资收益——赎回差价收入	-11,165,340.73	-29,766,158.88
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-30,240,058.95	-40,190,412.04

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	80,847,076.62	82,455,789.84
减：卖出股票成本总额	99,921,794.84	92,880,043.00
买卖股票差价收入	-19,074,718.22	-10,424,253.16

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	134,777,403.54	196,491,006.33
减：现金支付赎回款总额	6,980,280.54	7,465,064.33
减：赎回股票成本总额	138,962,463.73	218,792,100.88
赎回差价收入	-11,165,340.73	-29,766,158.88

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	144,855.89	208,584.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	135,800.00	181,500.00
减：应收利息总额	27.12	59.17
买卖债券差价收入	9,028.77	27,024.83

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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	4,151,991.86	5,704,374.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,151,991.86	5,704,374.59

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	65,461,104.46	-96,999,499.99
——股票投资	65,461,104.46	-96,999,499.99
——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	65,461,104.46	-96,999,499.99

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

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	229,973.78	243,113.74
银行间市场交易费用	-	-
合计	229,973.78	243,113.74

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	65,000.00	75,000.00
信息披露费	300,000.00	240,000.00
其他	150.00	100.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	325.00	400.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	625,475.00	575,500.00

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。

7.4.8 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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
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：1. 根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“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股份有限公司将所持大成基金 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. 下述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	73,871,762.06	49.06%	160,643,071.97	100.00%

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	144,855.89	100.00%	208,584.00	100.00%

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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	67,322.96	49.06%	4,560.40	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
光大证券	146,398.56	100.00%	-	0.00%

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。

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	1,919,338.25	2,733,729.48
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。

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	383,867.78	546,745.93

注：支付基金托管人中国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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

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 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
-------	--	---

	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	3,888,932.20	29,218.41	4,117,850.66	43,656.74

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	增发流通受限	11.06	53.21	4,842	53,552.52	257,642.82	-
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123004	铁汉转债	2017年12月18日	2018年1月26日	新债流通受限	100.00	100.00	320	32,000.00	32,000.00	-

		日	日							
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	新债流通受限	100.00	100.00	2,260	226,000.00	226,000.00	-
128027	崇达转债	2017年12月15日	2018年1月22日	新债流通受限	100.00	100.00	103	10,300.00	10,300.00	-
128028	赣锋转债	2017年12月21日	2018年1月19日	新债流通受限	100.00	100.00	316	31,600.00	31,600.00	-
128029	太阳转债	2017年12月22日	2018年1月16日	新债流通受限	100.00	100.00	285	28,500.00	28,500.00	-

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。

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
300104	乐视网	2017年4月17日	重大事项	15.33	2018年1月24日	13.80	128,000	2,921,760.53	1,962,240.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	52.04	-	-	27,200	2,375,029.75	1,415,488.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	7.35	-	-	158,951	1,551,144.31	1,168,289.85	-

002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002168	深圳惠程	2017年12月19日	重大事项	13.76	-	-	57,200	705,693.07	787,072.00	-
002470	金正大	2017年10月25日	重大事项	9.15	2018年2月9日	8.24	77,756	805,482.27	711,467.40	-
300156	神雾环保	2017年7月17日	重大事项	24.16	2018年1月17日	21.74	28,600	436,016.69	690,976.00	-
002366	台海核电	2017年12月6日	重大事项	26.45	-	-	25,000	762,919.81	661,250.00	-
300383	光环新网	2017年11月7日	重大事项	13.19	2018年3月19日	14.51	48,000	854,566.67	633,120.00	-
000930	中粮生化	2017年10月24日	重大事项	13.34	-	-	46,800	994,730.90	624,312.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	-	-	43,526	809,175.83	561,050.14	-
000547	航天发展	2017年10月30日	重大事项	10.83	-	-	51,800	1,314,376.02	560,994.00	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大事项	9.85	2018年3月8日	8.87	54,127	714,408.06	533,150.95	-
000031	中粮地产	2017年7月24日	重大事项	8.00	-	-	64,000	1,187,475.73	512,000.00	-

000592	平潭发展	2017年8月9日	重大事项	5.75	2018年1月29日	5.70	88,800	982,306.15	510,600.00	-
000979	中弘股份	2017年9月7日	重大事项	1.94	2018年2月14日	1.75	241,840	746,682.20	469,169.60	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大事项	10.40	2018年3月22日	9.36	45,100	703,323.95	469,040.00	-
000926	福星股份	2017年12月26日	重大事项	10.89	2018年1月10日	11.98	39,800	481,545.67	433,422.00	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项	4.99	-	-	86,788	545,280.79	433,072.12	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大事项	6.73	2018年3月14日	7.30	64,200	806,983.77	432,066.00	-
000806	银河生物	2017年7月18日	重大事项	10.76	2018年1月18日	10.01	37,458	1,056,860.56	403,048.08	-
300090	盛运环保	2017年12月1日	重大事项	9.24	-	-	43,100	461,256.11	398,244.00	-
002512	达华智能	2017年12月6日	重大事项	18.07	2018年3月6日	16.26	20,400	369,275.89	368,628.00	-
000034	神州数码	2017年9月29日	重大事项	21.60	-	-	16,500	365,242.39	356,400.00	-
000693	*ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50	2018年3月21日	11.88	26,800	517,816.87	335,000.00	-

300134	大富科技	2017年12月18日	重大事项	16.45	2018年3月19日	14.81	20,100	606,797.82	330,645.00	-
000766	通化金马	2017年11月24日	重大事项	13.60	-	-	20,800	369,785.00	282,880.00	-
000156	华数传媒	2017年12月26日	重大事项	11.40	-	-	24,300	694,359.49	277,020.00	-
002130	沃尔核材	2017年12月25日	重大事项	5.76	2018年1月10日	6.15	47,300	456,230.17	272,448.00	-
300010	立思辰	2017年11月17日	重大事项	11.17	2018年2月22日	10.05	22,861	581,205.50	255,357.37	-
002358	森源电气	2017年12月7日	重大事项	14.86	2018年3月7日	15.05	15,000	337,711.76	222,900.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项	7.62	-	-	28,600	266,576.00	217,932.00	-
300216	千山药机	2017年12月25日	重大事项	15.95	2018年1月18日	14.36	13,300	576,224.77	212,135.00	-
002625	光启技术	2017年12月20日	重大事项	28.07	2018年1月4日	30.88	6,900	340,291.23	193,683.00	-
000615	京汉股份	2017年12月26日	重大事项	9.76	2018年1月10日	10.74	19,600	276,262.72	191,296.00	-
300292	吴通控股	2017年12月4日	重大事项	5.67	2018年3月5日	5.72	30,700	269,214.77	174,069.00	-

300364	中文 在线	2017 年 12 月 28 日	重大 事项	9.23	2018 年 1 月 5 日	10.00	18,612	389,254.72	171,788.76	-
000564	供销 大集	2017 年 11 月 28 日	重大 事项	4.78	-	-	24,400	159,163.93	116,632.00	-
300730	科创 信息	2017 年 12 月 25 日	重大 事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣 健康	2017 年 12 月 28 日	重大 事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

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。

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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%(2016 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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、存出保证金、债券投资等。

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
--------------------	-------	-------	-------	-----	----

31 日					
资产					
银行存款	3,888,932.20	-	-	-	3,888,932.20
结算备付金	3,635.23	-	-	-	3,635.23
存出保证金	3,108.73	-	-	-	3,108.73
交易性金融资产	-	28,500.00	299,900.00	333,087,565.87	333,415,965.87
应收利息	-	-	-	837.78	837.78
资产总计	3,895,676.16	28,500.00	299,900.00	333,088,403.65	337,312,479.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	190,599.33	190,599.33
应付管理人报酬	-	-	-	143,868.13	143,868.13
应付托管费	-	-	-	28,773.62	28,773.62
应付交易费用	-	-	-	4,560.40	4,560.40
其他负债	-	-	-	315,000.00	315,000.00
负债总计	-	-	-	682,801.48	682,801.48
利率敏感度缺口	3,895,676.16	28,500.00	299,900.00	332,405,602.17	336,629,678.33
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	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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.10%(2016 年 12 月 31 日：无)，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)。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。

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	333,087,565.87	98.95	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	333,087,565.87	98.95	431,449,359.25	99.15
----	----------------	-------	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 1,660	增加约 2,095
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 1,660	减少约 2,095	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间, 本基金未发生申购交易。(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间, 本基金申购基金份额的对价总额为 3,435,450.73 元, 其中包括以股票支付的申购款 3,136,169.00 元和以现金支付的申购款 299,281.73 元)

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 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: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日, 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中属于第一层次的余额为 313,328,073.03 元, 属于第二层次的余额为 20,087,892.84 元, 无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 400,909,221.50 元, 第二层次 30,540,137.75 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 增值税

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，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、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(4) 除基金申购、公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	333,087,565.87	98.75
	其中：股票	333,087,565.87	98.75
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	328,400.00	0.10
	其中：债券	328,400.00	0.10
	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	3,892,567.43	1.15
8	其他各项资产	3,946.51	0.00
9	合计	337,312,479.81	100.00

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	7,998,214.80	2.38
B	采矿业	3,567,140.76	1.06
C	制造业	207,879,917.72	61.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,605,047.86	1.37
E	建筑业	6,286,459.74	1.87
F	批发和零售业	8,492,544.38	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	1,949,142.62	0.58
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,607,575.94	9.98
J	金融业	21,160,312.50	6.29
K	房地产业	17,673,353.83	5.25
L	租赁和商务服务业	4,945,659.25	1.47
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	5,679,601.14	1.69
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	2,986,205.64	0.89
R	文化、体育和娱乐业	5,077,763.33	1.51
S	综合	872,432.80	0.26
	合计	332,781,372.31	98.86

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	273,870.36	0.08
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	32,323.20	0.01
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	306,193.56	0.09

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	000333	美的集团	215,650	11,953,479.50	3.55
2	000651	格力电器	234,000	10,225,800.00	3.04
3	000725	京东方A	1,251,100	7,243,869.00	2.15
4	000858	五粮液	90,300	7,213,164.00	2.14
5	000002	万科A	200,300	6,221,318.00	1.85
6	002415	海康威视	156,625	6,108,375.00	1.81
7	000001	平安银行	415,300	5,523,490.00	1.64
8	300498	温氏股份	186,104	4,447,885.60	1.32
9	000063	中兴通讯	117,500	4,272,300.00	1.27
10	002304	洋河股份	27,562	3,169,630.00	0.94
11	002230	科大讯飞	50,150	2,965,871.00	0.88
12	002450	康得新	114,210	2,535,462.00	0.75
13	000776	广发证券	148,600	2,478,648.00	0.74
14	000568	泸州老窖	34,500	2,277,000.00	0.68
15	000538	云南白药	22,200	2,259,738.00	0.67
16	002024	苏宁云商	172,800	2,123,712.00	0.63
17	002008	大族激光	41,800	2,064,920.00	0.61
18	002142	宁波银行	113,388	2,019,440.28	0.60
19	002202	金风科技	106,020	1,998,477.00	0.59
20	000503	海虹控股	45,700	1,972,412.00	0.59
21	000338	潍柴动力	236,000	1,968,240.00	0.58
22	300104	乐视网	128,000	1,962,240.00	0.58
23	300136	信维通信	38,020	1,927,614.00	0.57
24	002456	欧菲科技	93,400	1,923,106.00	0.57
25	001979	招商蛇口	96,801	1,893,427.56	0.56
26	300059	东方财富	145,156	1,879,770.20	0.56
27	002594	比亚迪	28,100	1,827,905.00	0.54
28	002027	分众传媒	129,640	1,825,331.20	0.54
29	002236	大华股份	78,200	1,805,638.00	0.54
30	002460	赣锋锂业	24,500	1,757,875.00	0.52
31	000166	申万宏源	324,860	1,744,498.20	0.52
32	002241	歌尔股份	96,900	1,681,215.00	0.50
33	002466	天齐锂业	31,880	1,696,334.80	0.50

34	000100	TCL 集团	406,900	1,586,910.00	0.47
35	002475	立讯精密	66,625	1,561,690.00	0.46
36	000423	东阿阿胶	25,200	1,518,804.00	0.45
37	300072	三聚环保	43,167	1,516,456.71	0.45
38	300124	汇川技术	51,594	1,497,257.88	0.44
39	002739	万达电影	27,200	1,415,488.00	0.42
40	000069	华侨城 A	158,800	1,348,212.00	0.40
41	000625	长安汽车	106,188	1,337,968.80	0.40
42	000661	长春高新	7,280	1,332,240.00	0.40
43	000413	东旭光电	139,000	1,303,820.00	0.39
44	300070	碧水源	74,914	1,301,256.18	0.39
45	000895	双汇发展	48,400	1,282,600.00	0.38
46	002044	美年健康	58,500	1,279,395.00	0.38
47	000839	中信国安	133,300	1,278,347.00	0.38
48	000783	长江证券	162,000	1,274,940.00	0.38
49	002252	上海莱士	62,420	1,239,037.00	0.37
50	000963	华东医药	22,486	1,211,545.68	0.36
51	002673	西部证券	94,966	1,169,981.12	0.35
52	000540	中天金融	158,951	1,168,289.85	0.35
53	300024	机器人	61,366	1,154,908.12	0.34
54	002508	老板电器	23,890	1,149,109.00	0.34
55	002405	四维图新	42,500	1,121,575.00	0.33
56	002310	东方园林	55,000	1,109,350.00	0.33
57	000768	中航飞机	65,300	1,102,917.00	0.33
58	300003	乐普医疗	44,626	1,078,164.16	0.32
59	002085	万丰奥威	59,556	1,066,052.40	0.32
60	300408	三环集团	52,800	1,064,448.00	0.32
61	002081	金螳螂	69,163	1,059,577.16	0.31
62	002075	沙钢股份	64,600	1,041,352.00	0.31
63	002129	中环股份	90,500	1,039,845.00	0.31
64	000157	中联重科	231,800	1,036,146.00	0.31
65	002797	第一创业	105,420	1,033,116.00	0.31
66	002340	格林美	142,620	1,025,437.80	0.30
67	002271	东方雨虹	25,484	1,018,340.64	0.30
68	000425	徐工机械	219,300	1,015,359.00	0.30
69	000728	国元证券	91,800	1,009,800.00	0.30
70	000998	隆平高科	38,200	982,504.00	0.29
71	002736	国信证券	89,000	965,650.00	0.29
72	000623	吉林敖东	42,620	958,950.00	0.28

73	000792	盐湖股份	68,887	958,218.17	0.28
74	000786	北新建材	42,400	954,000.00	0.28
75	002572	索菲亚	25,708	946,054.40	0.28
76	000039	中集集团	41,400	945,990.00	0.28
77	002001	新和成	24,450	930,567.00	0.28
78	002049	紫光国芯	19,200	921,408.00	0.27
79	000630	铜陵有色	315,300	920,676.00	0.27
80	002714	牧原股份	16,700	882,762.00	0.26
81	000060	中金岭南	78,800	880,196.00	0.26
82	000050	深天马 A	44,600	879,066.00	0.26
83	300142	沃森生物	47,700	870,525.00	0.26
84	002422	科伦药业	34,700	864,030.00	0.26
85	000709	河钢股份	219,900	857,610.00	0.25
86	002146	荣盛发展	88,300	841,499.00	0.25
87	000826	启迪桑德	25,478	841,283.56	0.25
88	000977	浪潮信息	41,540	825,815.20	0.25
89	300017	网宿科技	76,952	818,769.28	0.24
90	002294	信立泰	17,900	808,901.00	0.24
91	300015	爱尔眼科	26,150	805,420.00	0.24
92	000983	西山煤电	79,100	802,074.00	0.24
93	300266	兴源环境	29,390	793,530.00	0.24
94	002179	中航光电	20,070	790,356.60	0.23
95	002168	深圳惠程	57,200	787,072.00	0.23
96	002050	三花智控	42,300	775,782.00	0.23
97	002311	海大集团	33,080	774,072.00	0.23
98	002465	海格通信	79,700	764,323.00	0.23
99	000008	神州高铁	87,000	761,250.00	0.23
100	300088	长信科技	97,000	759,510.00	0.23
101	000876	新希望	101,900	759,155.00	0.23
102	002092	中泰化学	56,700	754,677.00	0.22
103	300296	利亚德	38,600	752,314.00	0.22
104	000418	小天鹅 A	11,000	746,350.00	0.22
105	002500	山西证券	80,300	740,366.00	0.22
106	002573	清新环境	32,500	738,725.00	0.22
107	000488	晨鸣纸业	43,800	730,146.00	0.22
108	002007	华兰生物	27,000	725,760.00	0.22
109	002185	华天科技	83,780	713,805.60	0.21
110	000559	万向钱潮	70,228	712,814.20	0.21
111	002470	金正大	77,756	711,467.40	0.21

112	300433	蓝思科技	23,640	705,654.00	0.21
113	002065	东华软件	85,800	703,560.00	0.21
114	300027	华谊兄弟	80,131	699,543.63	0.21
115	002558	巨人网络	18,900	695,520.00	0.21
116	002176	江特电机	61,420	695,274.40	0.21
117	000690	宝新能源	86,500	692,000.00	0.21
118	300156	神雾环保	28,600	690,976.00	0.21
119	000066	中国长城	94,704	690,392.16	0.21
120	000009	中国宝安	95,360	689,452.80	0.20
121	000750	国海证券	140,550	688,695.00	0.20
122	000581	威孚高科	28,300	679,200.00	0.20
123	002074	国轩高科	30,490	678,707.40	0.20
124	000402	金融街	60,600	673,266.00	0.20
125	002366	台海核电	25,000	661,250.00	0.20
126	300274	阳光电源	35,180	660,328.60	0.20
127	300122	智飞生物	23,400	656,838.00	0.20
128	300355	蒙草生态	52,360	656,594.40	0.20
129	000671	阳光城	83,300	655,571.00	0.19
130	002038	双鹭药业	21,167	655,541.99	0.19
131	002385	大北农	107,850	653,571.00	0.19
132	000887	中鼎股份	35,700	648,669.00	0.19
133	000046	泛海控股	86,500	645,290.00	0.19
134	002019	亿帆医药	28,800	640,800.00	0.19
135	000686	东北证券	72,920	639,508.40	0.19
136	000970	中科三环	44,200	635,596.00	0.19
137	300383	光环新网	48,000	633,120.00	0.19
138	000656	金科股份	127,900	633,105.00	0.19
139	300055	万邦达	30,090	632,792.70	0.19
140	002410	广联达	31,900	625,240.00	0.19
141	000930	中粮生化	46,800	624,312.00	0.19
142	300144	宋城演艺	33,373	622,740.18	0.18
143	000513	丽珠集团	9,245	614,330.25	0.18
144	002273	水晶光电	25,750	607,442.50	0.18
145	002439	启明星辰	25,900	604,765.00	0.18
146	000878	云南铜业	42,500	603,075.00	0.18
147	002583	海能达	32,520	601,945.20	0.18
148	300315	掌趣科技	107,000	594,920.00	0.18
149	002384	东山精密	20,900	594,814.00	0.18
150	000933	神火股份	58,300	591,745.00	0.18

151	000997	新大陆	32,950	590,793.50	0.18
152	000961	中南建设	91,350	585,553.50	0.17
153	002217	合力泰	56,700	567,000.00	0.17
154	300146	汤臣倍健	37,700	566,254.00	0.17
155	002078	太阳纸业	61,000	566,080.00	0.17
156	300009	安科生物	21,760	564,236.80	0.17
157	002407	多氟多	27,600	563,592.00	0.17
158	000825	太钢不锈	113,600	563,456.00	0.17
159	002195	二三四五	96,370	562,800.80	0.17
160	002244	滨江集团	70,700	562,065.00	0.17
161	000778	新兴铸管	107,600	561,672.00	0.17
162	002223	鱼跃医疗	28,630	561,148.00	0.17
163	000566	海南海药	43,526	561,050.14	0.17
164	000547	航天发展	51,800	560,994.00	0.17
165	300182	捷成股份	64,834	558,220.74	0.17
166	002600	江粉磁材	66,400	555,768.00	0.17
167	000988	华工科技	33,200	550,456.00	0.16
168	300203	聚光科技	15,300	543,915.00	0.16
169	002493	荣盛石化	37,800	542,430.00	0.16
170	002426	胜利精密	92,900	541,607.00	0.16
171	000697	炼石有色	23,300	536,832.00	0.16
172	000006	深振业A	54,127	533,150.95	0.16
173	000999	华润三九	19,582	532,630.40	0.16
174	000807	云铝股份	52,000	531,960.00	0.16
175	300197	铁汉生态	43,730	531,319.50	0.16
176	300347	泰格医药	15,100	531,218.00	0.16
177	000960	锡业股份	40,121	529,597.20	0.16
178	000917	电广传媒	58,000	525,480.00	0.16
179	300115	长盈精密	26,080	523,425.60	0.16
180	002280	联络互动	68,250	522,795.00	0.16
181	000732	泰禾集团	26,100	522,522.00	0.16
182	000938	紫光股份	7,200	518,616.00	0.15
183	000415	渤海金控	89,800	517,248.00	0.15
184	002183	怡亚通	73,300	516,765.00	0.15
185	000598	兴蓉环境	94,400	512,592.00	0.15
186	000031	中粮地产	64,000	512,000.00	0.15
187	002408	齐翔腾达	40,300	511,004.00	0.15
188	000592	平潭发展	88,800	510,600.00	0.15
189	002221	东华能源	41,700	509,157.00	0.15

190	300418	昆仑万维	24,400	501,908.00	0.15
191	300166	东方国信	39,539	496,214.45	0.15
192	300251	光线传媒	47,180	493,031.00	0.15
193	002048	宁波华翔	20,600	490,280.00	0.15
194	300033	同花顺	9,800	489,804.00	0.15
195	002373	千方科技	33,300	487,845.00	0.14
196	300168	万达信息	36,000	485,280.00	0.14
197	002013	中航机电	44,875	484,201.25	0.14
198	002517	恺英网络	21,600	479,736.00	0.14
199	002281	光迅科技	16,200	476,280.00	0.14
200	000979	中弘股份	241,840	469,169.60	0.14
201	300159	新研股份	45,100	469,040.00	0.14
202	002285	世联行	41,940	467,631.00	0.14
203	300014	亿纬锂能	23,636	463,501.96	0.14
204	000883	湖北能源	100,100	463,463.00	0.14
205	002030	达安基因	24,938	463,348.04	0.14
206	300450	先导智能	8,000	455,760.00	0.14
207	002268	卫士通	19,760	454,875.20	0.14
208	000800	一汽轿车	42,200	454,072.00	0.13
209	000078	海王生物	76,950	454,005.00	0.13
210	000898	鞍钢股份	70,555	448,024.25	0.13
211	000627	天茂集团	55,900	447,200.00	0.13
212	002640	跨境通	23,300	445,962.00	0.13
213	002343	慈文传媒	12,500	445,125.00	0.13
214	002624	完美世界	13,200	441,672.00	0.13
215	002127	南极电商	36,200	441,278.00	0.13
216	002138	顺络电子	26,600	441,028.00	0.13
217	002153	石基信息	16,492	439,676.72	0.13
218	002051	中工国际	23,856	439,666.08	0.13
219	002440	闰土股份	22,200	437,118.00	0.13
220	002383	合众思壮	21,800	436,654.00	0.13
221	000729	燕京啤酒	64,700	436,078.00	0.13
222	002610	爱康科技	183,100	433,947.00	0.13
223	000926	福星股份	39,800	433,422.00	0.13
224	000939	凯迪生态	86,788	433,072.12	0.13
225	000012	南玻A	51,160	432,302.00	0.13
226	002004	华邦健康	64,200	432,066.00	0.13
227	000400	许继电气	32,700	431,313.00	0.13
228	002491	通鼎互联	34,200	430,920.00	0.13

229	000059	华锦股份	45,200	430,756.00	0.13
230	002056	横店东磁	40,100	429,070.00	0.13
231	000089	深圳机场	48,400	421,080.00	0.13
232	300145	中金环境	35,000	418,250.00	0.12
233	002191	劲嘉股份	44,100	407,925.00	0.12
234	000596	古井贡酒	6,200	407,154.00	0.12
235	000712	锦龙股份	23,900	405,822.00	0.12
236	002701	奥瑞金	64,900	405,625.00	0.12
237	002108	沧州明珠	35,692	405,461.12	0.12
238	002601	龙蟠佰利	25,300	405,306.00	0.12
239	000758	中色股份	63,000	405,090.00	0.12
240	000028	国药一致	6,700	403,675.00	0.12
241	000806	银河生物	37,458	403,048.08	0.12
242	002444	巨星科技	29,000	401,070.00	0.12
243	000975	银泰资源	30,001	400,813.36	0.12
244	002292	奥飞娱乐	28,000	400,120.00	0.12
245	002152	广电运通	53,650	399,156.00	0.12
246	300090	盛运环保	43,100	398,244.00	0.12
247	002389	南洋科技	18,800	397,244.00	0.12
248	002174	游族网络	17,700	394,710.00	0.12
249	002249	大洋电机	56,600	394,502.00	0.12
250	000703	恒逸石化	18,200	392,574.00	0.12
251	300170	汉得信息	32,900	391,510.00	0.12
252	300058	蓝色光标	70,919	391,472.88	0.12
253	300113	顺网科技	21,270	389,028.30	0.12
254	300199	翰宇药业	23,400	380,952.00	0.11
255	002477	雏鹰农牧	85,400	379,176.00	0.11
256	000021	深科技	38,966	379,139.18	0.11
257	002665	首航节能	56,910	379,020.60	0.11
258	000860	顺鑫农业	19,700	378,437.00	0.11
259	002131	利欧股份	145,534	378,388.40	0.11
260	000516	国际医学	77,300	377,997.00	0.11
261	300287	飞利信	51,000	377,910.00	0.11
262	002501	利源精制	36,400	377,468.00	0.11
263	002371	北方华创	9,100	377,104.00	0.11
264	300002	神州泰岳	61,018	373,430.16	0.11
265	300133	华策影视	34,284	371,638.56	0.11
266	300244	迪安诊断	15,672	370,172.64	0.11
267	300253	卫宁健康	55,052	369,398.92	0.11

268	002512	达华智能	20,400	368,628.00	0.11
269	002352	顺丰控股	7,300	367,628.00	0.11
270	300068	南都电源	22,600	363,408.00	0.11
271	002709	天赐材料	7,900	363,321.00	0.11
272	000738	航发控制	23,600	360,844.00	0.11
273	300324	旋极信息	24,600	359,898.00	0.11
274	000034	神州数码	16,500	356,400.00	0.11
275	300271	华宇软件	23,931	356,093.28	0.11
276	000027	深圳能源	58,600	355,116.00	0.11
277	002396	星网锐捷	16,400	354,076.00	0.11
278	002589	瑞康医药	26,280	353,466.00	0.11
279	002555	三七互娱	17,200	353,288.00	0.10
280	002151	北斗星通	10,950	350,619.00	0.10
281	002018	华信国际	49,110	347,207.70	0.10
282	002128	露天煤业	31,000	343,480.00	0.10
283	002595	豪迈科技	17,800	342,828.00	0.10
284	300026	红日药业	80,400	342,504.00	0.10
285	002424	贵州百灵	22,200	341,880.00	0.10
286	002155	湖南黄金	35,200	341,440.00	0.10
287	002506	协鑫集成	79,700	340,319.00	0.10
288	002630	华西能源	31,200	340,080.00	0.10
289	300053	欧比特	23,800	339,388.00	0.10
290	002672	东江环保	20,850	338,812.50	0.10
291	002635	安洁科技	12,850	335,256.50	0.10
292	000693	*ST 华泽	26,800	335,000.00	0.10
293	002390	信邦制药	39,600	334,620.00	0.10
294	002602	世纪华通	9,839	334,329.22	0.10
295	002468	申通快递	13,500	333,315.00	0.10
296	002421	达实智能	55,070	333,173.50	0.10
297	000601	韶能股份	46,100	331,920.00	0.10
298	300431	暴风集团	15,221	331,817.80	0.10
299	002400	省广股份	62,185	331,446.05	0.10
300	300073	当升科技	12,600	331,254.00	0.10
301	002411	必康股份	12,400	330,708.00	0.10
302	300134	大富科技	20,100	330,645.00	0.10
303	002431	棕榈股份	39,350	330,540.00	0.10
304	002002	鸿达兴业	48,261	330,105.24	0.10
305	300558	贝达药业	5,200	329,108.00	0.10
306	000685	中山公用	32,100	329,025.00	0.10

307	002670	国盛金控	16,900	328,705.00	0.10
308	002354	天神娱乐	19,220	328,662.00	0.10
309	300413	快乐购	11,000	328,350.00	0.10
310	300367	东方网力	21,762	328,170.96	0.10
311	000518	四环生物	47,900	327,636.00	0.10
312	000762	西藏矿业	20,858	327,470.60	0.10
313	002023	海特高新	31,700	326,827.00	0.10
314	000718	苏宁环球	75,209	325,654.97	0.10
315	002036	联创电子	20,000	324,600.00	0.10
316	000877	天山股份	31,200	324,480.00	0.10
317	002245	澳洋顺昌	31,600	323,900.00	0.10
318	300496	中科创达	10,000	323,200.00	0.10
319	002250	联化科技	30,400	322,848.00	0.10
320	002603	以岭药业	20,703	322,138.68	0.10
321	000937	冀中能源	55,290	321,787.80	0.10
322	002104	恒宝股份	36,600	320,982.00	0.10
323	002773	康弘药业	5,200	320,736.00	0.10
324	000667	美好置业	105,500	320,720.00	0.10
325	002266	浙富控股	74,040	320,593.20	0.10
326	300207	欣旺达	32,800	320,128.00	0.10
327	000902	新洋丰	32,602	318,847.56	0.09
328	002353	杰瑞股份	24,300	318,816.00	0.09
329	000727	华东科技	133,600	317,968.00	0.09
330	002299	圣农发展	21,900	315,360.00	0.09
331	300098	高新兴	23,700	315,210.00	0.09
332	002368	太极股份	12,408	314,790.96	0.09
333	000563	陕国投 A	73,900	314,075.00	0.09
334	002043	兔宝宝	25,550	313,243.00	0.09
335	002145	中核钛白	52,100	312,079.00	0.09
336	300083	劲胜智能	41,100	311,949.00	0.09
337	002489	浙江永强	51,900	311,919.00	0.09
338	000612	焦作万方	33,000	310,200.00	0.09
339	002716	金贵银业	16,400	309,468.00	0.09
340	300459	金科文化	27,400	304,962.00	0.09
341	000751	锌业股份	59,300	304,209.00	0.09
342	300001	特锐德	22,200	303,918.00	0.09
343	000829	天音控股	31,900	303,050.00	0.09
344	000848	承德露露	32,000	302,720.00	0.09
345	000587	金洲慈航	43,200	302,400.00	0.09

346	002067	景兴纸业	50,999	300,384.11	0.09
347	300077	国民技术	29,900	299,000.00	0.09
348	002608	江苏国信	29,300	297,688.00	0.09
349	002668	奥马电器	15,420	295,755.60	0.09
350	002251	步步高	16,300	294,215.00	0.09
351	002308	威创股份	24,000	292,800.00	0.09
352	002429	兆驰股份	81,600	292,128.00	0.09
353	002436	兴森科技	49,400	290,966.00	0.09
354	002831	裕同科技	5,200	290,576.00	0.09
355	002025	航天电器	12,870	290,475.90	0.09
356	000426	兴业矿业	29,500	289,985.00	0.09
357	002428	云南锗业	23,900	288,473.00	0.09
358	002277	友阿股份	49,000	287,630.00	0.09
359	300020	银江股份	24,572	287,492.40	0.09
360	002157	正邦科技	50,000	286,500.00	0.09
361	000061	农产品	37,332	285,963.12	0.08
362	002022	科华生物	21,000	285,810.00	0.08
363	300078	思创医惠	26,420	285,071.80	0.08
364	300101	振芯科技	21,100	283,162.00	0.08
365	000766	通化金马	20,800	282,880.00	0.08
366	002047	宝鹰股份	37,300	281,615.00	0.08
367	300474	景嘉微	5,200	280,384.00	0.08
368	002237	恒邦股份	26,400	280,368.00	0.08
369	000980	众泰汽车	23,400	279,396.00	0.08
370	000541	佛山照明	30,350	279,220.00	0.08
371	300212	易华录	10,300	279,130.00	0.08
372	300185	通裕重工	122,700	278,529.00	0.08
373	300118	东方日升	22,900	277,777.00	0.08
374	000156	华数传媒	24,300	277,020.00	0.08
375	300310	宜通世纪	23,860	276,537.40	0.08
376	002437	誉衡药业	39,800	274,222.00	0.08
377	002106	莱宝高科	26,925	273,827.25	0.08
378	002130	沃尔核材	47,300	272,448.00	0.08
379	001696	宗申动力	43,100	272,392.00	0.08
380	002302	西部建设	15,500	271,560.00	0.08
381	000901	航天科技	11,600	270,976.00	0.08
382	002055	得润电子	13,200	269,676.00	0.08
383	002123	梦网集团	25,900	268,065.00	0.08
384	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.08

385	300377	赢时胜	21,650	267,594.00	0.08
386	000090	天健集团	26,620	267,264.80	0.08
387	002399	海普瑞	17,480	267,094.40	0.08
388	000543	皖能电力	53,150	266,813.00	0.08
389	000969	安泰科技	29,900	265,811.00	0.08
390	000882	华联股份	86,400	263,520.00	0.08
391	300079	数码科技	62,400	262,704.00	0.08
392	000088	盐田港	34,100	261,547.00	0.08
393	002073	软控股份	32,600	260,800.00	0.08
394	002657	中科金财	11,300	257,866.00	0.08
395	002276	万马股份	29,800	256,876.00	0.08
396	002544	杰赛科技	16,323	256,760.79	0.08
397	300294	博雅生物	8,550	256,072.50	0.08
398	300010	立思辰	22,861	255,357.37	0.08
399	002375	亚厦股份	33,900	254,928.00	0.08
400	000600	建投能源	33,000	254,430.00	0.08
401	002643	万润股份	23,700	253,353.00	0.08
402	002063	远光软件	23,774	252,717.62	0.08
403	002699	美盛文化	13,820	250,280.20	0.07
404	002326	永太科技	21,900	250,098.00	0.07
405	000680	山推股份	49,000	249,410.00	0.07
406	300376	易事特	32,900	249,053.00	0.07
407	300036	超图软件	16,100	248,584.00	0.07
408	002434	万里扬	23,600	247,800.00	0.07
409	002089	新海宜	43,900	246,718.00	0.07
410	000049	德赛电池	6,200	245,458.00	0.07
411	300257	开山股份	17,400	243,600.00	0.07
412	000158	常山北明	30,670	243,519.80	0.07
413	000687	华讯方舟	23,100	242,781.00	0.07
414	002010	传化智联	15,000	242,700.00	0.07
415	002120	韵达股份	5,279	241,672.62	0.07
416	002505	大康农业	84,830	240,917.20	0.07
417	002180	纳思达	8,800	240,328.00	0.07
418	002041	登海种业	18,600	239,010.00	0.07
419	300202	聚龙股份	13,300	238,735.00	0.07
420	000617	中油资本	15,800	237,000.00	0.07
421	000973	佛塑科技	39,400	236,006.00	0.07
422	002261	拓维信息	30,300	234,522.00	0.07
423	002479	富春环保	24,100	234,011.00	0.07

424	002413	雷科防务	23,300	233,000.00	0.07
425	002303	美盈森	33,200	232,400.00	0.07
426	300267	尔康制药	34,400	231,512.00	0.07
427	300273	和佳股份	25,500	231,030.00	0.07
428	000777	中核科技	15,500	230,950.00	0.07
429	002642	荣之联	17,600	230,736.00	0.07
430	000620	新华联	40,401	230,285.70	0.07
431	002099	海翔药业	39,700	229,466.00	0.07
432	000519	中兵红箭	22,979	226,343.15	0.07
433	002482	广田集团	28,200	226,164.00	0.07
434	300458	全志科技	7,923	225,488.58	0.07
435	000875	吉电股份	57,400	223,286.00	0.07
436	002358	森源电气	15,000	222,900.00	0.07
437	000869	张裕A	5,900	221,250.00	0.07
438	000957	中通客车	19,600	220,696.00	0.07
439	000018	神州长城	35,900	219,708.00	0.07
440	300116	坚瑞沃能	28,600	217,932.00	0.06
441	000851	高鸿股份	25,200	215,208.00	0.06
442	002283	天润曲轴	37,500	214,500.00	0.06
443	002242	九阳股份	12,600	213,822.00	0.06
444	000062	深圳华强	9,100	213,759.00	0.06
445	300075	数字政通	13,200	213,576.00	0.06
446	300216	千山药机	13,300	212,135.00	0.06
447	002143	印纪传媒	16,060	211,992.00	0.06
448	000539	粤电力A	43,907	211,631.74	0.06
449	002147	新光圆成	16,330	211,310.20	0.06
450	300085	银之杰	15,277	207,767.20	0.06
451	300037	新宙邦	9,900	206,514.00	0.06
452	002563	森马服饰	26,200	205,932.00	0.06
453	000959	首钢股份	34,000	203,320.00	0.06
454	300291	华录百纳	17,800	202,030.00	0.06
455	300352	北信源	50,575	201,288.50	0.06
456	002503	搜于特	36,300	201,102.00	0.06
457	002522	浙江众成	22,700	199,760.00	0.06
458	002224	三力士	22,800	197,904.00	0.06
459	300222	科大智能	9,900	195,327.00	0.06
460	002625	光启技术	6,900	193,683.00	0.06
461	002474	榕基软件	22,900	192,818.00	0.06
462	002190	成飞集成	8,900	192,596.00	0.06

463	002325	洪涛股份	40,300	192,231.00	0.06
464	300304	云意电气	26,200	192,046.00	0.06
465	000615	京汉股份	19,600	191,296.00	0.06
466	002570	贝因美	26,500	190,800.00	0.06
467	002284	亚太股份	21,200	190,376.00	0.06
468	002052	同洲电子	33,710	188,776.00	0.06
469	002681	奋达科技	16,900	188,604.00	0.06
470	000881	中广核技	14,000	182,980.00	0.05
471	300043	星辉娱乐	29,700	181,764.00	0.05
472	002481	双塔食品	35,400	181,248.00	0.05
473	002287	奇正藏药	5,300	179,564.00	0.05
474	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.05
475	002110	三钢闽光	9,200	177,928.00	0.05
476	000555	神州信息	15,000	176,250.00	0.05
477	300292	吴通控股	30,700	174,069.00	0.05
478	300364	中文在线	18,612	171,788.76	0.05
479	002695	煌上煌	10,000	169,800.00	0.05
480	000801	四川九洲	29,600	169,312.00	0.05
481	300317	珈伟股份	10,700	167,562.00	0.05
482	002815	崇达技术	5,300	167,268.00	0.05
483	002588	史丹利	24,800	165,912.00	0.05
484	300369	绿盟科技	17,899	162,880.90	0.05
485	000558	莱茵体育	32,800	162,360.00	0.05
486	002329	皇氏集团	24,900	162,348.00	0.05
487	002818	富森美	5,300	160,643.00	0.05
488	300506	名家汇	7,000	155,750.00	0.05
489	300359	全通教育	15,600	150,696.00	0.04
490	002416	爱施德	15,900	150,573.00	0.04
491	300011	鼎汉技术	14,400	149,184.00	0.04
492	002619	艾格拉斯	23,220	148,608.00	0.04
493	002229	鸿博股份	15,200	142,880.00	0.04
494	000987	越秀金控	14,150	139,377.50	0.04
495	002568	百润股份	9,800	130,046.00	0.04
496	000607	华媒控股	21,300	129,078.00	0.04
497	300386	飞天诚信	7,800	123,708.00	0.04
498	000564	供销大集	24,400	116,632.00	0.03
499	300379	东方通	9,100	115,024.00	0.03
500	300368	汇金股份	10,900	93,522.00	0.03
501	002703	浙江世宝	11,100	91,908.00	0.03

502	002782	可立克	5,900	82,718.00	0.02
503	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
504	300713	英可瑞	455	38,629.50	0.01
505	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
506	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
507	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
508	002909	集泰股份	1,298	28,517.06	0.01
509	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
510	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00

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	002466	天齐锂业	4,842	257,642.82	0.08
2	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
3	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00

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	300498	温氏股份	6,950,064.60	1.60
2	300516	久之洋	1,685,766.00	0.39
3	002797	第一创业	1,561,589.00	0.36
4	000333	美的集团	1,211,506.00	0.28
5	002044	美年健康	1,116,060.98	0.26
6	002027	分众传媒	1,090,224.02	0.25
7	002558	巨人网络	1,064,997.66	0.24
8	000008	神州高铁	1,037,653.97	0.24
9	300296	利亚德	949,505.00	0.22
10	000059	华锦股份	808,377.00	0.19
11	300458	全志科技	742,730.00	0.17
12	002610	爱康科技	720,520.00	0.17
13	000413	东旭光电	690,719.00	0.16

14	002354	天神娱乐	617,908.00	0.14
15	000418	小天鹅 A	607,159.00	0.14
16	002127	南极电商	575,609.00	0.13
17	300145	中金环境	569,540.00	0.13
18	002716	金贵银业	561,592.98	0.13
19	300185	通裕重工	550,342.00	0.13
20	300118	东方日升	547,352.00	0.13

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	3,657,985.00	0.84
2	300516	久之洋	1,259,826.00	0.29
3	000651	格力电器	1,050,315.00	0.24
4	002450	康得新	856,728.00	0.20
5	000538	云南白药	766,555.40	0.18
6	000100	TCL 集团	740,978.00	0.17
7	000333	美的集团	665,404.00	0.15
8	002024	苏宁云商	621,404.00	0.14
9	000410	*ST 沈机	617,774.00	0.14
10	002312	*ST 三泰	570,575.00	0.13
11	000816	智慧农业	558,537.00	0.13
12	000725	京东方 A	546,495.00	0.13
13	000401	冀东水泥	538,502.32	0.12
14	002028	思源电气	532,618.22	0.12
15	000666	经纬纺机	527,425.00	0.12
16	000616	海航投资	517,866.00	0.12
17	300088	长信科技	503,653.00	0.12
18	000572	海马汽车	495,720.00	0.11
19	000858	五 粮 液	493,232.00	0.11
20	000830	鲁西化工	474,687.00	0.11

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。

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	75,019,433.73
卖出股票收入（成交）总额	80,847,076.62

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	328,400.00	0.10
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	328,400.00	0.10

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128024	宁行转债	2,260	226,000.00	0.07
2	123004	铁汉转债	320	32,000.00	0.01
3	128028	赣锋转债	316	31,600.00	0.01
4	128029	太阳转债	285	28,500.00	0.01
5	128027	崇达转债	103	10,300.00	0.00

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。

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，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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

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	3,108.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	837.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,946.51

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**

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。

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	300664	鹏鹞环保	32,323.20	0.01	新股未流通
2	002923	润都股份	16,227.54	0.00	新股未流通

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

9.1.1 本基金的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
8,278	3,471.29	341,210.00	1.19%	28,394,132.00	98.81%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

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	高建隆	208,300.00	0.72%
2	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.69%
3	林莹	197,096.00	0.68%
4	戴济民	196,967.00	0.68%
5	贺雅宁	196,965.00	0.68%
6	寇胜利	196,694.00	0.68%
7	吕君	180,000.00	0.62%
8	张小丽	166,838.00	0.57%
9	靳艳华	140,369.00	0.48%
10	谢元禄	131,444.00	0.45%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

无。

§10 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	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	28,735,342.00

§ 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、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 65,000.00 元。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	
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%	-
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%	-
西藏东财	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

国泰君安	2	76,701,374.71	51.00%	69,899.39	50.94%	-
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%	-
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%	-
光大证券	2	73,871,762.06	49.00%	67,322.96	49.06%	-
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%	-

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、南京证券。

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	144,855.89	100.00%	-	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	大成基金管理有限公司关于公司旗下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12月30日
2	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
3	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
4	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
5	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年11月27日

	的公告		
6	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
7	大成深证成份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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 24 日
13	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
14	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
15	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
16	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（2017 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 7 月 20 日
17	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（2017 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 7 月 20 日
18	大成深证成份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
19	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
20	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 7 月 7 日

	公告		
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
31	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
32	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
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	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
35	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
36	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

37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	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
43	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

无。

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。

13.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

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