

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.10 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.....	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§ 6 审计报告	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	48
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	48
8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	48
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	91
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	94
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	94

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	94
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金融衍生品投资明细.....	95
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	95
8.11 投资组合报告附注.....	95
§9 基金份额持有人信息.....	97
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	97
§10 开放式基金份额变动.....	98
§11 重大事件揭示.....	99
11.1 基金份额持有人大会决议.....	99
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.....	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	99
11.4 基金投资策略的改变.....	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	100
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.....	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	100
11.8 其他重大事件.....	101
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	107
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.....	107
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	107
§13 备查文件目录.....	108
13.1 备查文件目录.....	108
13.2 存放地点.....	108
13.3 查阅方式.....	108

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	148,919,838.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道	北京市西城区复兴门内大街 1

	7088 号招商银行大厦 32 层	号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金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

2.6 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	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标、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	14,925,133.68	696,093.18	14,360,385.22
本期利润	22,404,806.74	12,895,884.41	2,012,178.93
加权平均基金份额本期利润	0.1328	0.2419	0.0415
本期加权平均净值利润率	7.95%	15.93%	2.91%
本期基金份额净值增长率	9.03%	18.15%	2.35%
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	70,587,652.75	62,418,502.74	15,070,365.27
期末可供分配基金份额利润	0.4740	0.4264	0.4397
期末基金资产净值	260,221,752.56	240,760,344.44	49,342,400.60
期末基金份额净值	1.747	1.645	1.440
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	88.73%	73.10%	46.51%

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。

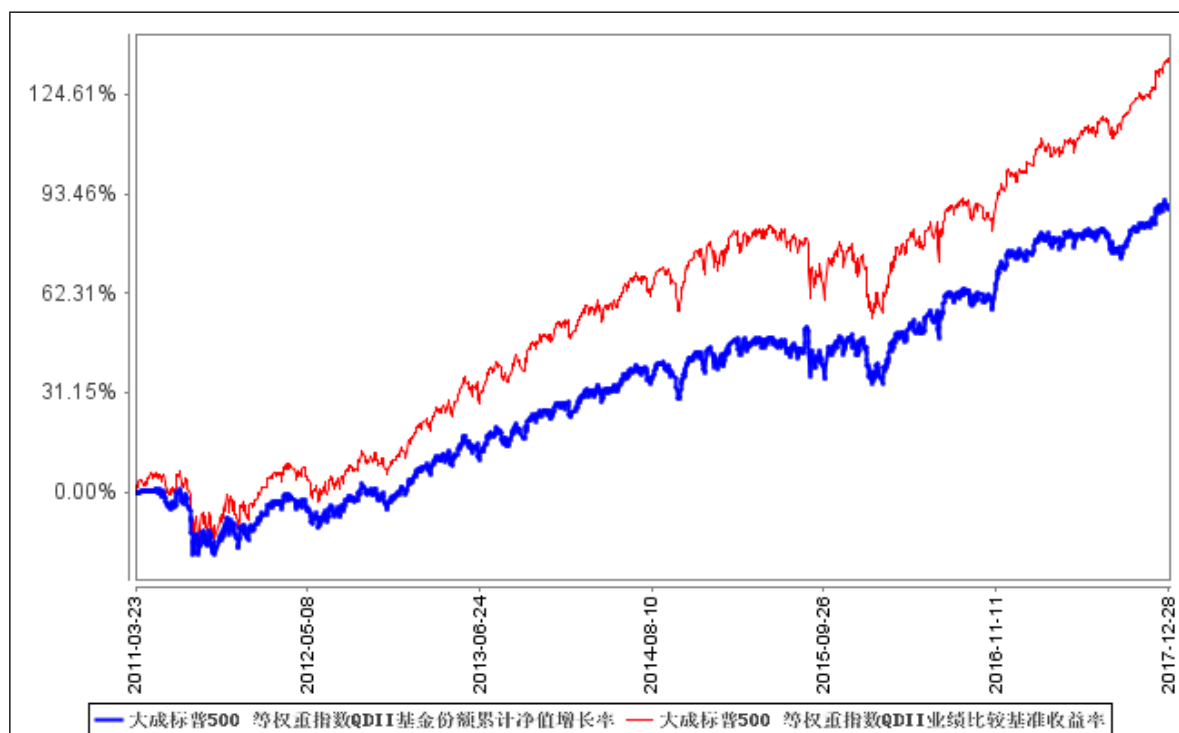
3.2 基金净值表现

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	3.86%	0.44%	6.22%	0.38%	-2.36%	0.06%

个月						
过去六 个月	4.86%	0.48%	10.04%	0.42%	-5.18%	0.06%
过去一 年	9.03%	0.49%	18.90%	0.46%	-9.87%	0.03%
过去三 年	31.85%	0.81%	33.49%	0.85%	-1.64%	-0.04%
过去五 年	87.79%	0.77%	108.10%	0.81%	-20.31%	-0.04%
自基金 合同生 效起至 今	88.73%	0.94%	134.69%	0.99%	-45.96%	-0.05%

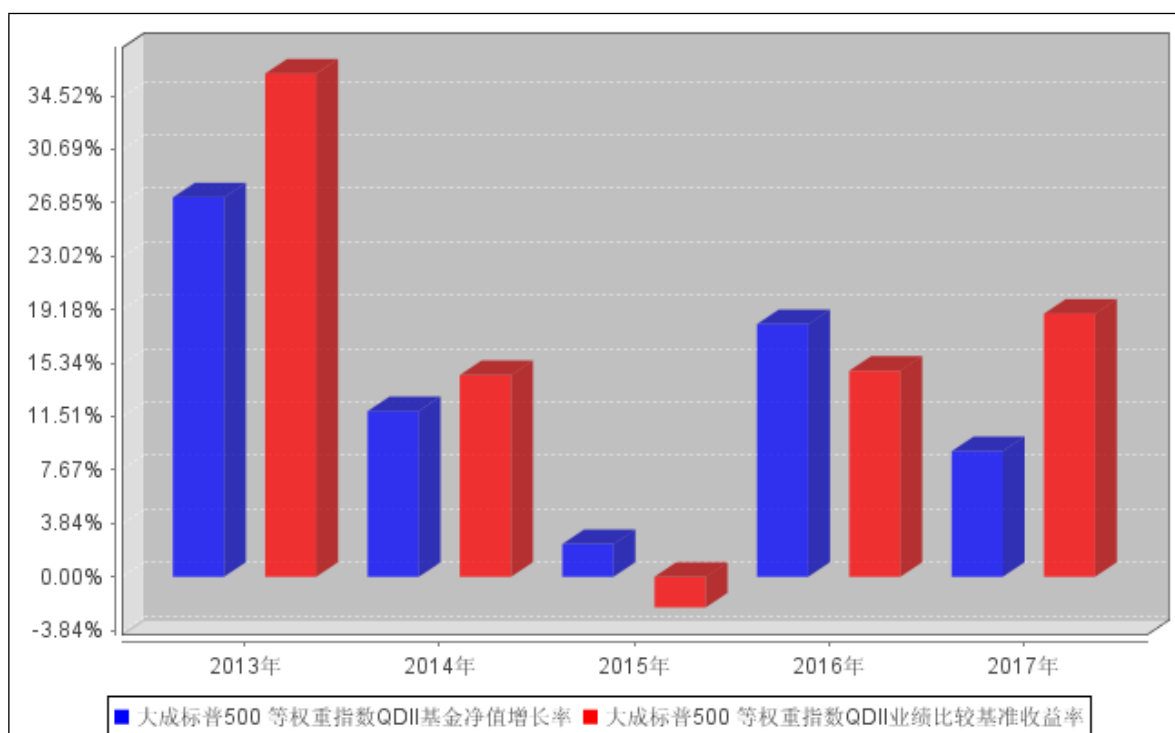
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时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。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	
2016	0.4400	719,098.30	794,654.18	1,513,752.48	
2015	0.1870	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	
合计	1.0560	5,896,204.49	4,181,325.08	10,077,529.57	

§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		
冉凌浩 生	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	14 年	金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员；2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等权

					重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 2 日起担任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016 年 12 月 29 日起担任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017 年 8 月 10 日起担任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，国际宏观经济以较快速度增长，美国宏观经济也保持了快速增长的势头。

从经济周期来看，美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，持续的技术创新导致其国际经济竞争力保持高位，同时经济复苏也导致了国内需求强盛。

首先，个人消费增长保持旺盛，这是美国经济增长的基石，不断增长的个人收入及保持高位的消费者信心指数保障了个人消费的持续增长。年内劳动力市场非常旺盛，失业率在 12 月份已

经降至 4.1%，创出了金融海啸以来的最低值。同时，繁荣的劳动力市场又促使美国个人消费增长保持旺盛，这使得美国经济处于良性循环过程中。

其次，房地产市场保持繁荣，虽然美国房价已超金融危机前高点，但我们认为美国房地产市场还有较大上涨空间。美国自有住房率当前在 64%，仍处于 30 年的低位。因此，房地产市场总体仍有上行空间，这也为美国经济增长奠定了基础。

美国 ISM 指数也在年内保持高位，并创出了金融危机之后的新高，这表明近期美国制造业的复苏正在持续展开。

由于上述因素的推动，美国 2017 年的实际 GDP 同比增速为 2.5%，保持在稳健增长的水平上。

由于宏观经济表现较好，美联储在年内启动了缩表进程，并在年内加息三次，而缩表与加息行为没有对宏观经济及股票市场产生较大的负面影响。

由于宏观经济的较佳表现，本基金的标的指数在年内创出了新高。但是，美元指数及美元汇率表现疲弱，这也一定程度的抵消了本基金的涨幅。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.747 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.03%，业绩比较基准收益率为 18.90%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，美国仍然处于本轮经济增长的中后期进程中，预计美国宏观经济还会保持快速增长的势头。

2017 年末，影响深远的美国大规模税改法案得以通过，并于 2018 年 1 月开始实施。减税是特朗普作出的诸多竞选承诺之一，该法案的通过及实施能有效巩固他的执政基础。2018 年开始实施的减税政策，首先将直接增加上市公司净利润，降低美股的估值水平；其次，个人可支配收入的提高会促进消费的增长；再次，企业税收的降低有望增强企业投资意愿。因此，减税有望提高 2018 年经济增长速度，利好美国经济。

美国良好的宏观经济前景及企业所得税率的降低将会继续促使企业盈利快速增长，预期 2018 年企业盈利增速在年化 15% 左右。同时，当前标普 500 指数的预期市盈率为 18 倍左右，基本位于正常的市盈率区间，因此，企业盈利的增加有望推动美股指数的增长。

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

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指

数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人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、制度执行及遵规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。

4.8 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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 7,216,098.77 元（每十份基金份额分红 0.429 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了大成标普 500 等权重指数证券投资基金(以下简称“大成标普 500 等权重指数基金”)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>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,公允反映了大成标普 500 等权重指数基金 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。</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,我们独立于大成标普 500 等权重指数基金,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>大成标普 500 等权重指数基金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标普 500 等权重指数基金的持续经营能力,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标普 500 等权重指数基金、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标普 500 等权重指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(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、</p>

	<p>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，就可能对大成标普 500 等权重指数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大成标普 500 等权重指数基金不能持续经营。</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：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

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	19,639,900.00	46,759,665.83
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	242,240,870.71	196,683,439.44
其中：股票投资		242,240,870.71	196,683,439.44
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	1,873.38	3,906.74
应收股利		296,914.38	216,849.79
应收申购款		2,189,484.60	6,588,685.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	314,640.55	-
资产总计		264,683,683.62	250,252,547.36
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		-	6,430,627.86
应付赎回款		3,971,308.85	2,741,103.50
应付管理人报酬		216,369.14	152,261.85
应付托管费		54,092.28	38,065.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
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	220,160.79	130,144.24
负债合计		4,461,931.06	9,492,202.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	148,919,838.60	146,373,605.04
未分配利润	7.4.7.10	111,301,913.96	94,386,739.40
所有者权益合计		260,221,752.56	240,760,344.44
负债和所有者权益总计		264,683,683.62	250,252,547.36

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.747 元，基金份额总额 148919838.6 份。

7.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至	2016 年 1 月 1 日至

		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
一、收入		26,653,479.76	14,454,542.91
1. 利息收入		62,964.49	27,610.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	62,964.49	27,610.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,066,910.44	2,432,297.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,919,772.43	617,262.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	6,147,138.01	1,815,034.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,479,673.06	12,199,791.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,337,570.42	-289,068.89
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	381,502.19	83,912.72
减：二、费用		4,248,673.02	1,558,658.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,818,757.01	792,175.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	704,689.24	198,043.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	89,147.00	46,183.84
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	636,079.77	522,255.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,404,806.74	12,895,884.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,404,806.74	12,895,884.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：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）	146,373,605.04	94,386,739.40	240,760,344.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	22,404,806.74	22,404,806.74
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）	2,546,233.56	1,726,466.59	4,272,700.15
其中：1. 基金申购款	196,670,215.20	131,158,801.42	327,829,016.62
2. 基金赎回款	-194,123,981.64	-129,432,334.83	-323,556,316.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-7,216,098.77	-7,216,098.77

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）	148,919,838.60	111,301,913.96	260,221,752.56
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）	34,272,035.33	15,070,365.27	49,342,400.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,895,884.41	12,895,884.41
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）	112,101,569.71	67,934,242.20	180,035,811.91
其中：1. 基金申购款	153,135,670.72	89,970,669.81	243,106,340.53
2. 基金赎回款	-41,034,101.01	-22,036,427.61	-63,070,528.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,513,752.48	-1,513,752.48
五、期末所有者权益（基金净值）	146,373,605.04	94,386,739.40	240,760,344.44

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

大成标普 500 等权重指数证券投资基金(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[2010]第 1876 号《关于核准大成标普 500 等权重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《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 822,469,878.87 元,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(2011)第 091 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 822,754,222.26 份基金份额,其中认购资金利息折合 284,343.39 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标普 500 等权重指数成份股、备选成份股,与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等,固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%,其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%,其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:标普 500 等权重指数(全收益指数)。

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》、《大成标普 500 等权重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。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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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；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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利

润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期间无须说明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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	19,639,900.00	46,759,665.83
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	19,639,900.00	46,759,665.83

注：于 2017 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,550,740.65 元，折合人民币 10,132,849.55 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,006,019.90 元，折合人民币 6,978,760.05 元)。

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		214,810,657.56	242,240,870.71	27,430,213.15
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		214,810,657.56	242,240,870.71	27,430,213.15
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		176,732,899.35	196,683,439.44	19,950,540.09
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		176,732,899.35	196,683,439.44	19,950,540.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：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	1,873.38	3,906.74
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	1,873.38	3,906.74

7.4.7.6 其他资产

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
其他应收款	314,640.55	-
待摊费用	-	-
合计	314,640.55	-

7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

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
应付赎回费	10,160.79	10,144.24
预提费用	210,000.00	120,000.00
合计	220,160.79	130,144.24

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	146,373,605.04	146,373,605.04
本期申购	196,670,215.20	196,670,215.20
本期赎回（以“-”号填列）	-194,123,981.64	-194,123,981.64
本期末	148,919,838.60	148,919,838.60

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,418,502.74	31,968,236.66	94,386,739.40
本期利润	14,925,133.68	7,479,673.06	22,404,806.74
本期基金份额交易产生的变动数	460,115.10	1,266,351.49	1,726,466.59
其中：基金申购款	81,422,765.46	49,736,035.96	131,158,801.42
基金赎回款	-80,962,650.36	-48,469,684.47	-129,432,334.83
本期已分配利润	-7,216,098.77	-	-7,216,098.77
本期末	70,587,652.75	40,714,261.21	111,301,913.96

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	62,964.49	26,988.73
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	622.09
合计	62,964.49	27,610.82

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	132,571,116.16	8,199,756.98
卖出股票成本总额	118,651,343.73	7,582,494.63
买卖股票差价收入	13,919,772.43	617,262.35

7.4.7.13 债券投资收益

注：本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	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
股票投资产生的股利收益	6,147,138.01	1,815,034.68
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,147,138.01	1,815,034.68

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	7,479,673.06	12,199,791.23
——股票投资	7,479,673.06	12,199,791.23
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	7,479,673.06	12,199,791.23

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017	2016 年 1 月 1 日至 2016

	年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	381,502.19	65,452.93
其他	-	18,459.79
合计	381,502.19	83,912.72

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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	89,147.00	46,183.84
银行间市场交易费用	-	-
合计	89,147.00	46,183.84

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	50,000.00	40,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
其他	50,802.73	-
银行划款手续费	13,711.84	25,824.86
指数使用费	281,565.20	216,430.50
合计	636,079.77	522,255.36

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年 8,000 美元收取，按年支付；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，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00 美元。

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

本基金的基金管理人于 2018 年 1 月 16 日宣告 2017 年度第 1 次分红，向截至 2018 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.4740 元。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)股份有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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

注：本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	2,818,757.01	792,175.38
其中：支付销售机构的客户维护费	1,098,116.50	289,621.15

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	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	704,689.24	198,043.92

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

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

注：本报告期及上年度可比期间内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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
	中银香港	10,132,607.72	-	6,978,643.09
中国银行	9,507,292.28	62,964.49	39,781,022.74	26,988.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
----	-------	-----	-------------	----------	-----------	----------	----

1	2017 年 1 月 19 日	2017 年 1 月 18 日	0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	
合计			0.4290	4,440,150.43	2,775,948.34	7,216,098.77	

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

注：于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

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

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国银行及境外次托管行中银香港，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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

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

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、应收申购款等。

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 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,639,900.00	-	-	-	19,639,900.00
交易性金融资产	-	-	-	242,240,870.71	242,240,870.71
应收利息	-	-	-	1,873.38	1,873.38
应收股利	-	-	-	296,914.38	296,914.38
应收申购款	51,080.68	-	-	2,138,403.92	2,189,484.60
其他	-	-	-	314,640.55	314,640.55
资产总计	19,690,980.68	-	-	244,992,702.94	264,683,683.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,971,308.85	3,971,308.85

应付管理人报酬	-	-	-	216,369.14	216,369.14
应付托管费	-	-	-	54,092.28	54,092.28
其他负债	-	-	-	220,160.79	220,160.79
负债总计	-	-	-	4,461,931.06	4,461,931.06
利率敏感度缺口	19,690,980.68	-	-	240,530,771.88	260,221,752.56
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	46,759,665.83	-	-	-	46,759,665.83
交易性金融资产	-	-	-	196,683,439.44	196,683,439.44
应收利息	-	-	-	3,906.74	3,906.74
应收股利	-	-	-	216,849.79	216,849.79
应收申购款	545,749.16	-	-	6,042,936.40	6,588,685.56
资产总计	47,305,414.99	-	-	202,947,132.37	250,252,547.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,430,627.86	6,430,627.86
应付赎回款	-	-	-	2,741,103.50	2,741,103.50
应付管理人报酬	-	-	-	152,261.85	152,261.85
应付托管费	-	-	-	38,065.47	38,065.47
其他负债	-	-	-	130,144.24	130,144.24
负债总计	-	-	-	9,492,202.92	9,492,202.92
利率敏感度缺口	47,305,414.99	-	-	193,454,929.45	240,760,344.44

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	10,132,849.55	-	-	10,132,849.55
交易性金融资产	242,240,870.71	-	-	242,240,870.71
应收股利	296,914.38	-	-	296,914.38
其它资产	314,640.55	-	-	314,640.55
资产合计	252,985,275.19	-	-	252,985,275.19
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	252,985,275.19	-	-	252,985,275.19
项目	上年度末			
	2016 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,978,760.05	-	-	6,978,760.05
交易性金融资产	196,683,439.44	-	-	196,683,439.44
应收股利	216,849.79	-	-	216,849.79
资产合计	203,879,049.28	-	-	203,879,049.28
以外币计价的负债				
应付证券清算款	6,430,627.86	-	-	6,430,627.86
负债合计	6,430,627.86	-	-	6,430,627.86
资产负债表外汇风险敞口净额	197,448,421.42	-	-	197,448,421.42

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）

))
	美元相对人民币升值 5%	12,650,000.00	9,870,000.00
	美元相对人民币贬值 5%	-12,650,000.00	-9,870,000.00

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	242,240,870.71	93.09	196,683,439.44	81.69
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	242,240,870.71	93.09	196,683,439.44	81.69

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%	12,440,000.00	11,280,000.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-12,440,000.00	-11,280,000.00

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) 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 242,240,870.71 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 196,683,439.44 元，无第二层次和第三层次)。

(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，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。

(2) 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。

(3)除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	242,240,870.71	91.52
	其中：普通股	242,240,870.71	91.52
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	19,639,900.00	7.42
8	其他各项资产	2,802,912.91	1.06
9	合计	264,683,683.62	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币

元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	242,240,870.71	93.09
合计	242,240,870.71	93.09

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
消费者非必需品	39,079,437.09	15.02
工业	33,648,264.82	12.93
信息技术	32,325,881.15	12.42
金融	32,245,981.82	12.39
医疗保健	29,568,441.08	11.36
消费者常用品	16,568,858.50	6.37
能源	16,418,473.78	6.31
房地产	15,829,113.36	6.08
公用事业	12,632,207.41	4.85
基础材料	12,363,972.15	4.75
电信服务	1,560,239.55	0.60
合计	242,240,870.71	93.09

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	美国	438	612,635.35	0.24
2	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克默伦股份有限公司	FCX UN	纽约交易所	美国	4,936	611,513.30	0.23
3	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	1,307	555,454.57	0.21
4	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	美国	2,702	552,790.84	0.21
5	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	美国	1,571	550,626.84	0.21
6	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽约交易所	美国	5,037	548,984.93	0.21
7	Coty Inc.	科蒂集团	COTY UN	纽约交易所	美国	4,156	540,135.53	0.21
8	Marathon Oil Corp	Marathon 石油公司	MRO UN	纽约交易所	美国	4,877	539,513.28	0.21
9	Arconic Inc	Arconic 公司	ARNC UN	纽约交易所	美国	3,020	537,731.99	0.21

10	Helmerich & Payne Inc	赫尔默里奇&佩恩公司	HP UN	纽约交易所	美国	1,273	537,677.89	0.21
11	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	美国	1,680	536,468.27	0.21
12	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	美国	855	536,438.87	0.21
13	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	美国	474	535,352.89	0.21
14	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	美国	2,265	533,094.67	0.20
15	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,084	528,680.55	0.20
16	Mylan Inc.	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,911	528,318.89	0.20
17	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	513	528,215.19	0.20
18	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	美国	1,093	526,070.92	0.20
19	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	1,484	525,854.90	0.20
20	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	美国	1,942	525,341.84	0.20
21	AllianceData Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约交易所	美国	317	525,043.62	0.20

22	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	美国	3,128	524,464.17	0.20
23	Lowes Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	美国	863	524,090.02	0.20
24	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	美国	771	523,686.40	0.20
25	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	1,882	523,129.88	0.20
26	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,066	520,667.93	0.20
27	Envision Healthcare Corp	Envision 医疗公司	EVHC UN	纽约交易所	美国	2,304	520,293.78	0.20
28	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	美国	20,081	519,604.55	0.20
29	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	美国	736	518,957.66	0.20
30	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	美国	1,446	518,625.60	0.20
31	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	1,159	518,532.75	0.20
32	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	2,514	517,942.64	0.20
33	Concho Resources Inc	康丘资源公司	CXO UN	纽约交易所	美国	527	517,286.09	0.20

34	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	美国	2,588	515,601.44	0.20
35	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 股份有限公司	DVA UN	纽约交易所	美国	1,091	515,056.68	0.20
36	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	美国	646	515,015.58	0.20
37	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	美国	832	514,614.77	0.20
38	Intel Corp	英特尔	INTC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,704	513,958.22	0.20
39	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	美国	753	513,871.18	0.20
40	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈巴奥米特控股公司	ZBH UN	纽约交易所	美国	651	513,301.73	0.20
41	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约交易所	美国	1,388	512,878.51	0.20
42	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	1,323	512,547.03	0.20
43	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	2,691	512,384.13	0.20
44	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	美国	4,596	512,331.99	0.20
45	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	美国	1,163	512,115.12	0.20

46	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交 易所	美国	2,087	511,655.57	0.20
47	Amerisource Bergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交 易所	美国	852	511,174.65	0.20
48	AT&T Inc	美国电话电报 公司	T UN	纽约交 易所	美国	2,012	511,147.99	0.20
49	Simon Property Group	西蒙房地产集 团公司	SPG UN	纽约交 易所	美国	455	510,593.50	0.20
50	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交 易所	美国	1,228	510,165.77	0.20
51	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有 限公司	WYNN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	463	510,041.16	0.20
52	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,947	509,519.60	0.20
53	Grainger W.W. Inc	固安捷公司	GWW UN	纽约交 易所	美国	330	509,422.57	0.20
54	Alaska Air Group Inc	阿拉斯加航空 集团公司	ALK UN	纽约交 易所	美国	1,059	508,668.46	0.20
55	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达 克交易 所	美国	2,523	507,927.09	0.20
56	Limited Brands Inc	L Brands 股份 有限公司	LB UN	纽约交 易所	美国	1,290	507,601.49	0.20
57	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达 克交易 所	美国	571	506,412.46	0.19

58	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	339	506,303.99	0.19
59	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	美国	843	506,270.67	0.19
60	Andeavor	Andeavor 公司	ANDV UN	纽约交易所	美国	677	505,800.53	0.19
61	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	美国	450	505,482.44	0.19
62	Baker Hughes Inc	贝克休斯通用能源公司	BHGE UN	纽约交易所	美国	2,442	504,864.18	0.19
63	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约交易所	美国	1,184	504,806.16	0.19
64	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	1,352	504,169.99	0.19
65	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克交易所	美国	5,792	504,109.87	0.19
66	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	美国	645	504,019.11	0.19
67	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	美国	961	503,919.14	0.19
68	Tapestry, Inc	蔻驰公司	TPR UN	纽约交易所	美国	1,743	503,740.36	0.19
69	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	美国	1,232	503,535.91	0.19

70	Vertex Pharmaceuticals Inc	Vertex 制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	美国	514	503,316.62	0.19
71	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	美国	1,753	503,308.65	0.19
72	Foot Locker Inc	富乐客公司	FL UN	纽约交易所	美国	1,643	503,289.18	0.19
73	Scripps Networks Interactive A	斯科利普斯网络互动公司	SNI UQ	纳斯达克交易所	美国	902	503,216.78	0.19
74	Everest Re Group Ltd	安富来集团有限公司	RE UN	纽约交易所	美国	348	503,123.47	0.19
75	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	1,001	503,113.27	0.19
76	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	美国	892	503,000.10	0.19
77	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	美国	592	502,988.08	0.19
78	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	美国	735	502,884.12	0.19
79	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	美国	864	502,623.21	0.19
80	Cardinal Health Inc	康德乐公司	CAH UN	纽约交易所	美国	1,254	502,039.44	0.19
81	Capital One	第一资本金融	COF UN	纽约交	美国	771	501,670.92	0.19

	Financial			易所				
82	United Continental Holding Inc	联合大陆控股 公司	UAL UN	纽约交 易所	美国	1,139	501,621.39	0.19
83	American Airlines Group Inc.	美国航空集团 公司	AAL UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,475	501,462.28	0.19
84	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交 易所	美国	572	501,207.12	0.19
85	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交 易所	美国	1,134	500,975.42	0.19
86	Church & Dwight Co	切迟杜威股份 有限公司	CHD UN	纽约交 易所	美国	1,526	500,254.56	0.19
87	Verizon Communicati ons Inc	Verizon 通信 股份有限公司	VZ UN	纽约交 易所	美国	1,446	500,106.63	0.19
88	Travelers Cos Inc	旅行者集团	TRV UN	纽约交 易所	美国	564	499,872.57	0.19
89	Nordstrom Inc	诺德斯特龙公 司	JWN UN	纽约交 易所	美国	1,614	499,678.90	0.19
90	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交 易所	美国	1,000	499,604.93	0.19
91	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达 克交易 所	美国	7,434	499,353.50	0.19
92	United Technologie s Corp	联合技术	UTX UN	纽约交 易所	美国	599	499,307.17	0.19
93	Southwest	西南航空	LUV UN	纽约交	美国	1,167	499,083.18	0.19

	Airlines Co			易所				
94	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,825	498,938.44	0.19
95	Total System Services Inc	全系统服务公 司	TSS UN	纽约交 易所	美国	965	498,702.23	0.19
96	Brown- Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交 易所	美国	1,111	498,509.60	0.19
97	Smucker J. M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交 易所	美国	614	498,450.73	0.19
98	CHARTER COMMUNICATI ON-A	特许通讯	CHTR UQ	纳斯达 克交易 所	美国	227	498,317.17	0.19
99	Parker- Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交 易所	美国	382	498,164.53	0.19
100	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交 易所	美国	1,347	498,080.70	0.19
101	Walt Disney Co	华特迪士尼	DIS UN	纽约交 易所	美国	709	498,066.72	0.19
102	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交 易所	美国	487	498,039.14	0.19
103	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交 易所	美国	402	497,847.62	0.19
104	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交 易所	美国	1,596	497,756.28	0.19
105	Affiliated Managers	联合经理集团 股份有限公司	AMG UN	纽约交 易所	美国	371	497,564.63	0.19

	Group							
106	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	305	497,316.00	0.19
107	Dr Pepper Snapple Group	澎泉思蓝宝集团 公司	DPS UN	纽约交易所	美国	784	497,220.21	0.19
108	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	美国	258	497,166.24	0.19
109	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF UN	纽约交易所	美国	1,970	497,002.36	0.19
110	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	美国	1,040	496,891.93	0.19
111	Schein Henry Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,088	496,791.57	0.19
112	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UQ	纳斯达克交易所	美国	634	496,790.52	0.19
113	LyondellBas ell Industries N.V.	利安德巴塞尔 工业公司	LYB UN	纽约交易所	美国	689	496,667.68	0.19
114	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	美国	2,769	496,658.33	0.19
115	HCA Holdings Inc	HCA 医疗保健 有限公司	HCA UN	纽约交易所	美国	865	496,478.97	0.19
116	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	美国	1,090	496,351.55	0.19
117	Norfolk	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	美国	524	496,126.12	0.19

	Southern Corp			易所				
118	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	美国	1,355	495,815.10	0.19
119	Nvidia Corp	英伟达	NVDA UQ	纳斯达克交易所	美国	392	495,632.14	0.19
120	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	美国	1,285	495,390.37	0.19
121	Hess Corp	赫斯公司	HES UN	纽约交易所	美国	1,597	495,355.02	0.19
122	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	美国	2,861	495,213.23	0.19
123	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约交易所	美国	1,329	495,158.93	0.19
124	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	美国	763	495,119.40	0.19
125	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	美国	1,466	494,762.44	0.19
126	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	美国	1,793	494,641.95	0.19
127	Acuity Brands Inc	敏锐品牌公司	AYI UN	纽约交易所	美国	430	494,508.26	0.19
128	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	美国	922	494,433.37	0.19
129	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	美国	653	494,397.89	0.19

130	Progressive Corp	前进保险公司	PGR UN	纽约交易所	美国	1,343	494,232.25	0.19
131	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG UN	纽约交易所	美国	1,093	494,075.30	0.19
132	CSRA Inc	CSRA 股份有限公司	CSRA UN	纽约交易所	美国	2,527	494,036.75	0.19
133	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	美国	1,246	493,951.67	0.19
134	ANSYS Inc	ANSYS 股份有限公司	ANSS UQ	纳斯达克交易所	美国	512	493,763.88	0.19
135	Clorox Co	高乐氏公司	CLX UN	纽约交易所	美国	508	493,723.63	0.19
136	Wal-Mart Stores	沃尔玛股份有限公司	WMT UN	纽约交易所	美国	765	493,617.97	0.19
137	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	956	493,551.39	0.19
138	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	756	493,442.14	0.19
139	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	美国	588	493,211.61	0.19
140	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	美国	484	493,200.11	0.19
141	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	1,531	493,190.31	0.19
142	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,110	493,128.89	0.19

143	T Rowe Price Group Inc	普信集团公司	TROW UQ	纳斯达克交易 所	美国	719	492,970.56	0.19
144	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交 易所	美国	296	492,737.23	0.19
145	Martin Marietta	马丁玛丽埃塔 材料公司	MLM UN	纽约交 易所	美国	341	492,512.97	0.19
146	Gartner Inc	高德纳咨询股 份有限公司	IT UN	纽约交 易所	美国	612	492,468.28	0.19
147	Chevron Corp	雪佛龙	CVX UN	纽约交 易所	美国	602	492,445.93	0.19
148	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融 服务	HIG UN	纽约交 易所	美国	1,339	492,410.26	0.19
149	Pentair Ltd.	Pentair 公共 有限公司	PNR UN	纽约交 易所	美国	1,067	492,362.03	0.19
150	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达 克交易 所	美国	856	492,208.22	0.19
151	Federal Realty Invt Trust	联邦房地产投 资信托公司	FRT UN	纽约交 易所	美国	567	492,046.63	0.19
152	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交 易所	美国	472	491,951.55	0.19
153	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公 司	MPC UN	纽约交 易所	美国	1,141	491,915.35	0.19

154	Johnson Controls Inc	江森自控国际有限公司	JCI UN	纽约交易所	美国	1,975	491,811.26	0.19
155	Patterson Cos Inc	帕特森公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	美国	2,083	491,755.99	0.19
156	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	486	491,713.19	0.19
157	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT UN	纽约交易所	美国	942	491,555.58	0.19
158	Michael Kors Holdings Ltd	迈克尔高司控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	美国	1,195	491,536.83	0.19
159	Cisco Systems Inc	思科-T	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,964	491,510.37	0.19
160	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	863	491,496.51	0.19
161	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	美国	628	491,473.51	0.19
162	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	383	491,385.24	0.19
163	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,374	491,006.32	0.19
164	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	2,206	490,956.00	0.19
165	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交	美国	1,188	490,908.70	0.19

				易所				
166	Assurant Inc	艾斯兰公司	AIZ UN	纽约交易所	美国	745	490,887.00	0.19
167	LKQ Corp	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,847	490,832.70	0.19
168	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	美国	643	490,818.13	0.19
169	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	美国	865	490,657.33	0.19
170	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	425	490,535.46	0.19
171	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	2,543	490,518.21	0.19
172	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	美国	817	490,496.00	0.19
173	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德 摩根公司	KMI UN	纽约交易所	美国	4,154	490,475.22	0.19
174	Phillips 66	Phillips 66 公司	PSX UN	纽约交易所	美国	742	490,413.27	0.19
175	Universal Health Services	环球健康服务 公司	UHS UN	纽约交易所	美国	662	490,311.34	0.19
176	Robert Half Intl Inc	罗致恒富国际 公司	RHI UN	纽约交易所	美国	1,351	490,290.69	0.19
177	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	485	490,194.38	0.19
178	Accenture	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易所	美国	490	490,157.13	0.19

	plc			易所				
179	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	美国	959	489,899.16	0.19
180	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	纽约交易所	美国	761	489,744.11	0.19
181	Walgreens Boots Alliance	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克克交易所	美国	1,032	489,698.04	0.19
182	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	美国	3,715	489,617.73	0.19
183	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克克交易所	美国	1,183	489,460.98	0.19
184	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	美国	2,067	489,194.25	0.19
185	Extra Space Storage Inc	Extra Space 仓储公司	EXR UN	纽约交易所	美国	856	489,131.92	0.19
186	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克克交易所	美国	654	489,044.10	0.19
187	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	美国	1,631	488,956.02	0.19
188	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	美国	674	488,893.68	0.19
189	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	美国	588	488,870.03	0.19
190	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	美国	233	488,788.54	0.19

191	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	656	488,739.34	0.19
192	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	Verisk 分析公司	VRSK UQ	纳斯达克交易所	美国	779	488,653.61	0.19
193	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	美国	1,329	488,645.97	0.19
194	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	美国	429	488,592.84	0.19
195	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	美国	894	488,589.32	0.19
196	Regions Financial Corp	地区金融公司	RF UN	纽约交易所	美国	4,326	488,452.88	0.19
197	ConAgra Foods Inc	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG UN	纽约交易所	美国	1,984	488,348.33	0.19
198	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	美国	990	488,075.34	0.19
199	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	美国	637	487,778.23	0.19
200	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约交易所	美国	1,030	487,739.48	0.19
201	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	美国	393	487,600.56	0.19
202	Hunt J.B. Transport Services	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT UQ	纳斯达克交易所	美国	649	487,595.20	0.19

203	Mastercard Inc A	万事达股份有 限公司	MA UN	纽约交 易所	美国	493	487,585.14	0.19
204	L-3 Communicati ons Holdings	L3 科技股份有 限公司	LLL UN	纽约交 易所	美国	377	487,382.38	0.19
205	PayPal Holdings Inc.	Paypal 控股股 份有限公司	PYPL UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,013	487,301.43	0.19
206	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交 易所	美国	1,310	487,223.93	0.19
207	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交 易所	美国	649	487,086.32	0.19
208	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交 易所	美国	697	487,040.84	0.19
209	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交 易所	美国	1,153	486,993.40	0.19
210	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交 易所	美国	1,007	486,915.52	0.19
211	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约交 易所	美国	1,394	486,858.67	0.19
212	NRG Energy	NRG 能源股份 有限公司	NRG UN	纽约交 易所	美国	2,616	486,821.95	0.19
213	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天 然气公司	COG UN	纽约交 易所	美国	2,605	486,817.50	0.19
214	Air Products & Chemicals Inc	空气产品公司	APD UN	纽约交 易所	美国	454	486,747.72	0.19
215	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交	美国	1,498	486,670.88	0.19

				易所				
216	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物 流有限公司	CHRW UQ	纳斯达 克交易 所	美国	836	486,662.25	0.19
217	Global Payments Inc	环汇公司	GPN UN	纽约交 易所	美国	743	486,656.24	0.19
218	Torchmark Corp	Torchmark 公 司	TMK UN	纽约交 易所	美国	821	486,620.89	0.19
219	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交 易所	美国	3,561	486,539.86	0.19
220	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交 易所	美国	814	486,514.19	0.19
221	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达 克交易 所	美国	993	486,439.89	0.19
222	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交 易所	美国	6,868	486,016.67	0.19
223	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交 易所	美国	525	485,923.95	0.19
224	MGM Resorts Internation al	美高梅国际酒 店集团	MGM UN	纽约交 易所	美国	2,227	485,880.04	0.19
225	DOWDUPONT INC	陶氏杜邦	DWDP UN	纽约交 易所	美国	1,044	485,841.82	0.19
226	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达 克交易 所	美国	869	485,714.92	0.19
227	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交 易所	美国	736	485,678.20	0.19

228	Horton D. R. Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约交 易所	美国	1,455	485,535.82	0.19
229	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团	CFG UN	纽约交 易所	美国	1,770	485,521.12	0.19
230	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,593	485,266.68	0.19
231	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交 易所	美国	2,604	484,929.12	0.19
232	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达 克交易 所	美国	4,825	484,893.18	0.19
233	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交 易所	美国	801	484,867.96	0.19
234	Alexandria Real Estate Eqty	亚历山大房地 产股份有限公 司	ARE UN	纽约交 易所	美国	568	484,675.07	0.19
235	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交 易所	美国	629	484,652.59	0.19
236	Stanley Black & Decker	史丹利百得公 司	SWK UN	纽约交 易所	美国	437	484,540.53	0.19
237	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交 易所	美国	1,482	484,474.73	0.19
238	Expeditors Intl of WA Inc	华盛顿康捷国 际物流公司	EXPD UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,146	484,411.22	0.19
239	Mondelez Internation	Mondelez 国际 公司	MDLZ UQ	纳斯达 克交易	美国	1,732	484,377.63	0.19

	al Inc			所				
240	Applied Materials Inc	应用材料—T	AMAT UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,450	484,341.04	0.19
241	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易 所	美国	2,641	484,226.43	0.19
242	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易 所	美国	386	484,161.74	0.19
243	Zoetis Inc When Issued	硕腾股份有限 公司	ZTS UN	纽约交 易所	美国	1,028	483,904.03	0.19
244	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交 易所	美国	779	483,767.08	0.19
245	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	Ulta 美妆公司	ULTA UQ	纳斯达克交易 所	美国	331	483,736.37	0.19
246	PNC Finl Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交 易所	美国	513	483,666.52	0.19
247	American Water Works Co Inc	美国自来水股 份有限公司	AWK UN	纽约交 易所	美国	809	483,631.49	0.19
248	Hologic Inc	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,731	483,532.43	0.19
249	Hewlett Packard Enterpris	慧与	HPE UN	纽约交 易所	美国	5,153	483,511.72	0.19

250	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	美国	1,241	483,130.78	0.19
251	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	443	482,972.45	0.19
252	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	美国	518	482,897.37	0.19
253	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX UQ	纳斯达克交易所	美国	163	482,713.11	0.19
254	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	美国	1,438	482,681.75	0.19
255	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	2,308	482,439.07	0.19
256	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	美国	538	482,347.98	0.19
257	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	美国	2,433	482,336.48	0.19
258	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	美国	2,142	482,311.00	0.19
259	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	美国	180	482,271.01	0.19
260	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	美国	328	482,245.39	0.19
261	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	美国	756	482,179.27	0.19

262	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	436	482,121.24	0.19
263	GenenalGrow thPropertie sIn	GGP 股份有限 公司	GGP UN	纽约交 易所	美国	3,154	482,041.39	0.19
264	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交 易所	美国	1,033	482,005.26	0.19
265	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交 易所	美国	1,123	481,953.71	0.19
266	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,451	481,925.54	0.19
267	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达 克交易 所	美国	702	481,911.10	0.19
268	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔品牌公 司	NWL UN	纽约交 易所	美国	2,386	481,749.58	0.19
269	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金 融公司	AMP UN	纽约交 易所	美国	435	481,697.63	0.19
270	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK UN	纽约交 易所	美国	1,166	481,589.23	0.19
271	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交 易所	美国	3,655	481,471.22	0.19
272	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	63	481,417.71	0.19
273	Raymond	瑞杰金融公司	RJF UN	纽约交	美国	825	481,390.85	0.18

	James Financial Inc			易所				
274	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁 曼	NOC UN	纽约交 易所	美国	240	481,298.72	0.18
275	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG UN	纽约交 易所	美国	611	481,283.36	0.18
276	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交 易所	美国	362	481,236.64	0.18
277	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,150	481,067.41	0.18
278	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交 易所	美国	793	480,958.02	0.18
279	Kimberly- Clark	金佰利	KMB UN	纽约交 易所	美国	610	480,934.11	0.18
280	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交 易所	美国	630	480,730.24	0.18
281	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交 易所	美国	791	480,727.04	0.18
282	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交 易所	美国	911	480,676.99	0.18
283	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交 易所	美国	838	480,653.40	0.18
284	Microchip Technology Inc	微芯科技股份 有限公司	MCHP UQ	纳斯达 克交易 所	美国	837	480,626.74	0.18
285	Aptiv plc	Aptiv 公共有	APTV UN	纽约交	美国	867	480,574.79	0.18

		限公司		易所				
286	Centene Corp	Centene 公司	CNC UN	纽约交易所	美国	729	480,535.00	0.18
287	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	美国	430	480,431.63	0.18
288	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	美国	2,085	480,375.43	0.18
289	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	1,081	480,174.70	0.18
290	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	1,268	480,054.08	0.18
291	Dentsply Intl	登士柏西诺德公司	XRAY UQ	纳斯达克交易所	美国	1,116	480,043.37	0.18
292	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	美国	143	480,005.80	0.18
293	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	2,207	479,930.19	0.18
294	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	美国	808	479,865.90	0.18
295	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	美国	1,743	479,823.23	0.18
296	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	美国	708	479,692.09	0.18
297	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	美国	1,096	479,604.53	0.18

298	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	美国	266	479,541.02	0.18
299	CBOE Holdings Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE UQ	纳斯达克交易所	美国	589	479,502.53	0.18
300	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件公司	AAP UN	纽约交易所	美国	736	479,426.28	0.18
301	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	美国	465	479,399.23	0.18
302	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	美国	1,694	479,395.57	0.18
303	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	美国	525	479,303.17	0.18
304	Peoples United Financial Inc	人民联合金融股份有限公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	3,922	479,227.38	0.18
305	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约交易所	美国	4,040	479,126.75	0.18
306	TransDigm Group	TransDigm 集团公司	TDG UN	纽约交易所	美国	267	479,110.68	0.18
307	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	美国	1,397	478,960.72	0.18
308	CVS Caremark Corp.	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	美国	1,011	478,940.52	0.18
309	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	2,268	478,820.16	0.18

310	CSX Corp	CSX 公司	CSX UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	1,332	478,782.53	0.18
311	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交 易所	美国	1,104	478,777.04	0.18
312	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交 易所	美国	771	478,647.86	0.18
313	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交 易所	美国	1,367	478,590.03	0.18
314	Digital Realty Trust	数字房地产信 托有限公司	DLR UN	纽约交 易所	美国	643	478,549.78	0.18
315	Ingersoll- Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交 易所	美国	821	478,466.73	0.18
316	Philip Morris Internation al	菲利普莫里斯 国际集团公司	PM UN	纽约交 易所	美国	693	478,404.39	0.18
317	Amgen Inc	安进公司	AMGN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	421	478,381.20	0.18
318	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	335	478,265.21	0.18
319	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交 易所	美国	1,005	478,265.21	0.18
320	IHS Markit Ltd	IHS Markit 有 限公司	INFO UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,621	478,226.01	0.18
321	Intl Business	国际商业机器	IBM UN	纽约交 易所	美国	477	478,181.51	0.18

	Machines Corp							
322	SunTrust Banks Inc (GA)	太阳信托银行	STI UN	纽约交易所	美国	1,133	478,175.83	0.18
323	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳斯达克交易所	美国	941	478,121.53	0.18
324	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	美国	1,674	478,110.94	0.18
325	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约交易所	美国	350	477,976.73	0.18
326	Mettler-Toledo Intl	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	纽约交易所	美国	118	477,671.97	0.18
327	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	美国	1,029	477,516.59	0.18
328	SBA COMMUNICATIONS CORP-CLASS A	SBA 通信公司	SBAC UQ	纳斯达克交易所	美国	447	477,139.83	0.18
329	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	美国	680	476,805.80	0.18
330	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	美国	310	476,765.94	0.18
331	Rockwell	洛克威尔克林	COL UN	纽约交	美国	538	476,758.49	0.18

	Collins	斯		易所				
332	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易 所	美国	392	476,728.96	0.18
333	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易 所	美国	556	476,724.25	0.18
334	Regeneron Pharmaceuticals	再生元制药股 份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易 所	美国	194	476,579.98	0.18
335	United Parcel Service Inc B	联合包裹服务 股份有限公司	UPS UN	纽约交 易所	美国	612	476,472.56	0.18
336	UDR Inc	UDR 公司	UDR UN	纽约交 易所	美国	1,893	476,463.15	0.18
337	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地 产信托公司	ESS UN	纽约交 易所	美国	302	476,302.28	0.18
338	Lam Research Corp	科林研发股份 有限公司	LRCX UQ	纳斯达克交易 所	美国	396	476,289.08	0.18
339	FORTUNE BRANDS HOME SECURITY, INC	Fortune Brands 家庭与 安全用品	FBHS UN	纽约交 易所	美国	1,065	476,268.69	0.18
340	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交 易所	美国	404	476,196.55	0.18
341	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,070	475,987.72	0.18

				所				
342	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克交易所	美国	767	475,863.90	0.18
343	AbbVie Inc	艾伯维生物制药公司	ABBV UN	纽约交易所	美国	753	475,837.63	0.18
344	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	美国	693	475,778.04	0.18
345	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	美国	4,172	475,698.91	0.18
346	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	2,497	475,608.41	0.18
347	Roper Industries Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	美国	281	475,552.54	0.18
348	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	美国	1,066	475,044.18	0.18
349	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	美国	387	475,022.94	0.18
350	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,466	474,837.83	0.18
351	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约交易所	美国	720	474,837.70	0.18
352	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	美国	696	474,608.74	0.18
353	Citigroup	花旗集团	C UN	纽约交	美国	976	474,540.79	0.18

	Inc			易所				
354	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	827	474,452.18	0.18
355	Principal Financial Group	信安金融	PFG UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,029	474,423.69	0.18
356	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	美国	1,509	474,369.79	0.18
357	DISH NETWORK CORP-A	DISH 网络公司	DISH UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,520	474,252.24	0.18
358	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	美国	102	474,119.85	0.18
359	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	美国	1,184	474,092.28	0.18
360	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易 所	美国	414	474,052.03	0.18
361	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	美国	366	474,046.54	0.18
362	DXC Technology Company	DXC 技术公司	DXC UN	纽约交易所	美国	764	473,753.02	0.18
363	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	美国	2,556	473,652.14	0.18
364	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有 限公司	QRVO UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,088	473,473.36	0.18
365	McCormick &	味好美	MKC UN	纽约交	美国	711	473,455.13	0.18

	Co			易所				
366	INCYTE CORP	Incyte 有限公司	INCY UQ	纳斯达克交易 所	美国	765	473,423.37	0.18
367	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易 所	美国	4,976	473,406.45	0.18
368	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易 所	美国	3,811	473,383.91	0.18
369	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易 所	美国	3,448	473,353.65	0.18
370	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易 所	美国	5,800	473,350.52	0.18
371	Prudential Financial Inc	保德信金融集 团	PRU UN	纽约交易 所	美国	630	473,320.46	0.18
372	eBay Inc.	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,919	473,226.76	0.18
373	Smith A. O. Corp	AO 史密斯公司	AOS UN	纽约交易 所	美国	1,181	472,891.03	0.18
374	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,260	472,826.47	0.18
375	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易 所	美国	941	472,649.20	0.18
376	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易 所	美国	637	472,461.02	0.18

377	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	464	472,456.12	0.18
378	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	1,142	472,273.55	0.18
379	Albemarle Corp	雅保公司	ALB UN	纽约交 易所	美国	565	472,147.24	0.18
380	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社 区股份有限公 司	AVB UN	纽约交 易所	美国	405	472,135.48	0.18
381	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	551	472,113.13	0.18
382	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	689	471,951.35	0.18
383	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有 限公司	HRL UN	纽约交 易所	美国	1,984	471,754.60	0.18
384	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交 易所	美国	473	471,668.16	0.18
385	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交 易所	美国	2,864	471,404.37	0.18
386	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克 克交易 所	美国	907	471,336.09	0.18
387	Lilly Eli & Co	礼来	LLY UN	纽约交 易所	美国	854	471,304.27	0.18
388	Quanta Services Inc	Quanta 服务股 份有限公司	PWR UN	纽约交 易所	美国	1,844	471,238.92	0.18

389	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约交易所	美国	798	471,059.10	0.18
390	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	美国	938	470,897.19	0.18
391	Fortive Corp	Fortive 公司	FTV UN	纽约交易所	美国	996	470,858.37	0.18
392	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	美国	600	470,854.45	0.18
393	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	美国	1,117	470,839.23	0.18
394	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST UN	纽约交易所	美国	3,630	470,825.05	0.18
395	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	美国	2,167	470,807.08	0.18
396	Duke Realty Corp	杜克房地产公司	DRE UN	纽约交易所	美国	2,648	470,802.70	0.18
397	Mid-America Apt Communities	MAA 房产信托	MAA UN	纽约交易所	美国	716	470,468.67	0.18
398	Allergan Inc	艾尔建有限公司	AGN UN	纽约交易所	美国	440	470,300.35	0.18
399	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	美国	2,759	470,166.53	0.18
400	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	美国	418	470,110.60	0.18
401	Chubb Corp	安达保险有限	CB UN	纽约交	美国	492	469,782.58	0.18

		公司		交易所				
402	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	美国	1,412	469,433.66	0.18
403	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	646	469,174.51	0.18
404	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	美国	1,656	468,858.12	0.18
405	BROADCOM Ltd	博通有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	美国	279	468,339.44	0.18
406	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	美国	425	468,319.18	0.18
407	S&P Global Inc	标普全球	SPGI UN	纽约交易所	美国	423	468,215.94	0.18
408	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	美国	1,961	468,207.71	0.18
409	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	美国	878	468,198.82	0.18
410	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	美国	325	468,172.16	0.18
411	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	美国	467	467,973.65	0.18
412	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	美国	1,123	467,938.30	0.18
413	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	美国	1,179	467,853.10	0.18
414	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克	美国	1,062	467,848.98	0.18

				克交易 所				
415	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交 易所	美国	883	467,749.47	0.18
416	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠悦 公共有限公司	WLTW UQ	纳斯达 克交易 所	美国	475	467,703.33	0.18
417	Intercontin entalExchan ge	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交 易所	美国	1,014	467,507.90	0.18
418	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股 有限公司	NCLH UN	纽约交 易所	美国	1,342	466,943.73	0.18
419	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 股份 有限公司	MMC UN	纽约交 易所	美国	878	466,936.68	0.18
420	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交 易所	美国	288	466,830.43	0.18
421	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交 易所	美国	484	466,824.42	0.18
422	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交 易所	美国	533	466,685.63	0.18
423	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交 易所	美国	532	466,435.76	0.18
424	NextEra Energy Inc	新纪元能源公 司	NEE UN	纽约交 易所	美国	457	466,403.55	0.18
425	Archer- Daniels- Midland Co	Archer- Daniels- Midland 公司	ADM UN	纽约交 易所	美国	1,780	466,165.51	0.18

426	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	美国	896	465,795.41	0.18
427	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易 所	美国	995	465,769.54	0.18
428	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业 集团	PEG UN	纽约交 易所	美国	1,384	465,731.64	0.18
429	Booking Holdings Inc	Booking Holdings 公司	PCLN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	41	465,544.37	0.18
430	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约交 易所	美国	1,738	465,500.46	0.18
431	Fidelity National Information	富达国民信息 服务公司	FIS UN	纽约交 易所	美国	757	465,405.78	0.18
432	Block H & R Inc	H&R Block 公 司	HRB UN	纽约交 易所	美国	2,715	465,152.06	0.18
433	Borgwarner Inc	博格华纳股份 有限公司	BWA UN	纽约交 易所	美国	1,392	464,694.53	0.18
434	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集 团	JEC UN	纽约交 易所	美国	1,078	464,613.51	0.18
435	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,000	464,450.94	0.18
436	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交 易所	美国	2,867	464,404.74	0.18

437	ResMed Inc	瑞思迈股份有限公司	RMD UN	纽约交易所	美国	839	464,286.99	0.18
438	Salesforce.com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	695	464,253.93	0.18
439	Welltower Inc	Welltower 股份有限公司	HCN UN	纽约交易所	美国	1,114	464,188.13	0.18
440	Cooper Companies Inc	库柏股份有限公司	COO UN	纽约交易所	美国	326	464,116.91	0.18
441	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	美国	402	463,516.02	0.18
442	Nielsen Holdings NV	尼尔森控股有限公司	NLSN UN	纽约交易所	美国	1,947	463,083.98	0.18
443	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	美国	194	462,610.64	0.18
444	The Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约交易所	美国	1,314	462,438.66	0.18
445	Brighthouse Financial Inc	Brighthouse 金融股份有限公司	BHF UQ	纳斯达克交易所	美国	1,206	462,097.58	0.18
446	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	美国	294	462,090.52	0.18
447	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,049	461,916.39	0.18

448	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	美国	348	461,806.68	0.18
449	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,186	461,641.36	0.18
450	Chicago Mercantile Exchange	芝加哥商业交易所集团股份 有限公司	CME UQ	纳斯达克交易 所	美国	483	460,936.52	0.18
451	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	美国	1,285	460,880.98	0.18
452	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有 限公司	IDXX UQ	纳斯达克交易 所	美国	451	460,840.01	0.18
453	Waters Corp	沃特世公司	WAT UN	纽约交易所	美国	365	460,754.87	0.18
454	Gallagher Arthur J. & Co	亚瑟加拉格尔 有限公司	AJG UN	纽约交易所	美国	1,114	460,621.37	0.18
455	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	美国	2,004	460,403.91	0.18
456	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	美国	1,490	460,316.09	0.18
457	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS UQ	纳斯达克交易 所	美国	826	460,061.52	0.18
458	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计 系统股份有限 公司	CDNS UQ	纳斯达克交易 所	美国	1,682	459,623.73	0.18
459	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	美国	864	459,491.22	0.18

460	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	1,710	459,453.58	0.18
461	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	美国	1,389	458,882.75	0.18
462	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	1,095	458,846.88	0.18
463	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	美国	1,861	458,802.32	0.18
464	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	美国	1,268	458,346.42	0.18
465	Biogen Idec Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	220	457,952.02	0.18
466	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约交易所	美国	1,109	457,829.31	0.18
467	Dominion Resources Inc	Dominion 能源公司	D UN	纽约交易所	美国	864	457,628.19	0.18
468	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	美国	1,167	457,600.94	0.18
469	Wisconsin Energy Corp	WEC 能源集团股份有限公司	WEC UN	纽约交易所	美国	1,053	457,072.45	0.18
470	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	美国	1,447	454,690.34	0.17
471	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	617	454,401.79	0.17

472	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控股股 份有限公司	IQV UN	纽约交 易所	美国	709	453,546.01	0.17
473	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交 易所	美国	1,757	452,450.03	0.17
474	Consolidate d Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交 易所	美国	815	452,390.44	0.17
475	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交 易所	美国	939	451,397.11	0.17
476	Alliant Energy Corp	Alliant 能源 公司	LNT UN	纽约交 易所	美国	1,621	451,322.49	0.17
477	Royal Caribbean Cruises	皇家加勒比海 游轮有限公司	RCL UN	纽约交 易所	美国	579	451,272.24	0.17
478	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交 易所	美国	1,824	451,110.71	0.17
479	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交 易所	美国	2,251	450,373.79	0.17
480	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交 易所	美国	2,681	449,691.94	0.17
481	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交 易所	美国	818	449,565.90	0.17
482	Align Technology Inc	Align 科技股 份有限公司	ALGN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	309	448,616.67	0.17
483	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交 易所	美国	1,163	448,281.21	0.17
484	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交 易所	美国	1,448	447,529.97	0.17

485	Kansas City Southern Inc	堪萨斯南方铁路公司	KSU UN	纽约交易所	美国	650	446,893.54	0.17
486	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	美国	624	446,305.72	0.17
487	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	美国	796	443,040.19	0.17
488	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,408	442,619.39	0.17
489	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	美国	233	440,039.10	0.17
490	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	美国	2,142	433,184.14	0.17
491	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	美国	615	429,661.55	0.17
492	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	1,008	416,528.59	0.16
493	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	美国	1,593	414,069.25	0.16
494	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	美国	1,382	404,826.75	0.16
495	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	3,373	357,266.08	0.14
496	21st Century Fox	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,570	354,232.70	0.14

497	Discovery Communicati onsC	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达 克交易 所	美国	2,219	306,952.08	0.12
498	Under armour-A equity	安德玛公司	UAA UN	纽约交 易所	美国	2,853	269,005.11	0.10
499	Under Armour Inc Class A	安德玛公司	UA UN	纽约交 易所	美国	2,871	249,879.05	0.10
500	Discovery Communicati onsA	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,681	245,821.70	0.09
501	Alphabet Inc-CL A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达 克交易 所	美国	35	240,909.42	0.09
502	Alphabet Inc-CL C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达 克交易 所	美国	35	239,308.54	0.09
503	TWENTY- FIRST CENTURY FOX - B	21 世纪福克斯	FOX UQ	纳斯达 克交易 所	美国	655	146,030.22	0.06
504	News Corp B	新闻集团	NWS UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,075	116,602.80	0.04

8.4.1 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Advanced Micro Devices	AMD UQ	864,566.44	0.36
2	Incyte Corp	INCY UQ	859,861.62	0.36
3	DISH Network Corp A	DISH UQ	812,926.79	0.34
4	Regency Centers Corp	REG UN	694,956.48	0.29
5	Range Resources Corp	RRC UN	679,356.15	0.28
6	Gartner Inc	IT UN	661,727.64	0.27
7	IHS Markit Ltd	INFO UQ	655,050.25	0.27
8	Alexandria Real Estate Eqty	ARE UN	650,855.70	0.27
9	Everest Re Group Ltd	RE UN	647,930.91	0.27
10	Synopsys Inc	SNPS UQ	636,340.55	0.26
11	Baker Hughes Inc	BHGE UN	623,127.07	0.26
12	Cboe Global Markets, Inc	CBOE UQ	619,316.27	0.26
13	Raymond James Financial Inc	RJF UN	618,243.19	0.26
14	IDEXX Laboratories Inc	IDXX UQ	615,517.26	0.26

15	Signet Jewelers Ltd	SIG UN	599,498.29	0.25
16	Envision Healthcare Corp	EVHC UN	596,083.59	0.25
17	Duke Realty Corp	DRE UN	587,469.41	0.24
18	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	585,657.10	0.24
19	ResMed Inc	RMD UN	576,109.33	0.24
20	Mattel Inc	MAT UQ	565,926.74	0.24

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	Whole Foods Market Inc	WFM UQ	862,116.87	0.36
2	ALTABA INC	AABA UQ	776,334.16	0.32
3	Mead Johnson Nutrition Co	MJN UN	738,682.96	0.31
4	DowDuPont Inc.	DWDP UN	715,757.98	0.30
5	Staples Inc	SPLS UQ	699,495.23	0.29
6	Mallinckrodt plc	MNK UN	660,112.46	0.27
7	Dun & Bradstreet Corp	DNB UN	639,862.16	0.27
8	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UQ	637,882.80	0.26

9	Southwestern Energy Co	SWN UN	637,451.77	0.26
10	AutoNation Inc	AN UN	622,351.90	0.26
11	Murphy Oil Corp	MUR UN	621,382.85	0.26
12	Harman Intl Industries Inc	HAR UN	611,951.16	0.25
13	Nvidia Corp	NVDA UQ	610,054.94	0.25
14	Teradata Corp	TDC UN	607,433.53	0.25
15	NRG Energy	NRG UN	596,447.18	0.25
16	Transocean Ltd	RIG UN	573,018.49	0.24
17	Micron Technology Inc	MU UQ	571,354.73	0.24
18	Enbridge Inc	ENB UN	568,591.21	0.24
19	Ryder System Inc	R UN	551,276.08	0.23
20	Activision Blizzard Inc	ATVI UQ	546,339.26	0.23

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	156,728,123.09
卖出收入（成交）总额	132,571,116.16

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：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前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

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

8.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	296,914.38
4	应收利息	1,873.38
5	应收申购款	2,189,484.60
6	其他应收款	314,640.55
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,802,912.91

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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
40,186	3,705.76	2,695,886.90	1.81%	146,223,951.70	98.19%

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	178,008.58	0.1197%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 23 日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	146,373,605.04
本报告期基金总申购份额	196,670,215.20
减:本报告期基金总赎回份额	194,123,981.64
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	148,919,838.60

§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

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），

本年度支付的审计费用为 5 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	
摩根士丹利	-	289,446,498.53	100.00%	86,132.18	100.00%	-

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用境内证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度（包括但不限于公平交易制度及保密制度），能满足各投资组合运作高度保密的要求；

(五) 证券研究或市场研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务, 并能根据各投资组合投资的特定要求, 提供专题研究报告;

(六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

(七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

(八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

(九) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个工作日内, 汇总上半年境外券商综合服务评价结果, 作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划, 报部门及公司分管领导批准;

交易量分配计划获批后, 作为选择交易券商的依据, 供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时, 及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作, 并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括: 长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、湘财证券、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无新增的境内交易单元, 退租境内交易单元: 渤海证券、中投证券; 无新增或退租境外交易单元。

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

注: 无。

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	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 12 月 28 日
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 12 月 21 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报	2017 年 12 月 12 日

	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	刊及本公司网站	
5	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
6	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
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 11 月 21 日
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 2 期）摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 11 月 7 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 11 月 7 日
10	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
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
12	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
13	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
14	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 9 月 4 日

	股份有限公司为销售机构的公告		
15	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
16	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 8 月 31 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
18	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
19	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
20	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
21	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳市金斧子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 7 月 25 日
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
23	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
24	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

25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 30 日
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2017 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 8 日
32	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2017 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 8 日
33	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
34	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日

	交易费率优惠的公告		
35	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
36	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增加江西银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
37	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
38	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 12 日
39	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
40	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
41	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
42	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
43	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
44	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
45	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
46	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

47	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 16 日
48	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 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
49	大成标普 500 等权重指数证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 18 日
50	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
51	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 12 日
52	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
53	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
54	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
55	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

§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

注：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标普 500 等权重指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

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