

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	32
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	32
7.4 期末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	33
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	68

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	69
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	70
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	70
7.10 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 .....	70
7.11 投资组合报告附注 .....	70
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
8.3 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情况 .....	71
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
10.4 基金投资策略的改变 .....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
10.8 其他重大事件 .....	74
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>75</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录 .....	75
12.2 存放地点 .....	75
12.3 查阅方式 .....	75

## 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	95,018,873.17 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
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号 招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	刘连舸

## 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	中文	中国银行（香港）有限公司
	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	3,199,952.25
本期利润	27,780,591.56
加权平均基金份额本期利润	0.2768
本期加权平均净值利润率	15.85%
本期基金份额净值增长率	17.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	52,459,061.35
期末可供分配基金份额利润	0.5521
期末基金资产净值	175,660,212.43
期末基金份额净值	1.849
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	112.66%

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额, 不是当期发生数)。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.57%	0.64%	7.54%	0.68%	-0.97%	-0.04%
过去三个月	5.30%	0.74%	3.72%	0.77%	1.58%	-0.03%
过去六个月	17.39%	0.78%	19.19%	0.81%	-1.80%	-0.03%
过去一年	10.43%	0.91%	8.18%	0.94%	2.25%	-0.03%
过去三年	36.83%	0.76%	42.05%	0.77%	-5.22%	-0.01%
自基金合同生效起至今	112.66%	0.94%	158.36%	0.98%	-45.70%	-0.04%

### 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

大成标普500等权重指数QDII累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六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,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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。

## § 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。

经过二十年的稳健发展,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2019年6月30日,本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金,5只QDII基金及68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	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	16 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，曾担任金融工程师、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 日起任大成恒生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 3 月 20 日起任大成中华沪深港 300 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

无。

#### 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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。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不存在同日反向交易。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

2019 年上半年，全球主要经济体的经济增速有所放缓，全球股票市场也出现了较大幅度的波动。

从宏观经济数据来看，美国上半年宏观经济仍然保持在相对尚可的水平上，但是经济增速有所降低。最新公布的 2019 年 2 季度的年化季环比 GDP 增速为 2.1%，虽然与 1 季度相比大幅下降，

但仍然保持在 2% 以上。

与此同时，美联储的加息的节奏也会放缓。当前普遍预计美联储在年内有可能出现降息行为。美联储货币政策逐步向鸽派行为转变，使得市场信心也逐步得以修复。

美股在 1 季度的大幅上涨之后，于 5 月份出现了大幅下跌，其主要原因是：（1）市场担心美国经济在 2019 年大幅下滑甚至陷入经济衰退，从而引发了投资者的心理恐慌情绪而快速抛售美股；（2）中美贸易谈判在 5 月份遭遇重大挫折，一度中止谈判进程，美国的贸易战行为实际上也损害了美国上市公司的业务，因此影响美股出现下跌；（3）美国国债长短期收益率长期倒挂，表明市场对未来经济增长充满忧虑。

进入到 6 月份后，一方面，陆续公布的宏观经济数据显示美国并没有陷入衰退，另一方面，中美贸易谈判有峰会路转的迹象，中美贸易谈判重新开启，这些都在一定程度上打消了市场的疑虑，因此美国主要股指重新走好，并创出了历史新高。

#### 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 1.849 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.39%，业绩比较基准收益率为 19.19%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在已经公布财报的公司中，去除波音公司因素（波音公司因 737Max 客机停飞而造成巨大损失），2 季度美国上市公司总体运营状况有所改善，盈利增长中位数超过 4%，好于之前的预期。

未来美国 GDP 增速仍有望保持在 2% 以上，从而本基金标的指数成分股公司盈利仍然会保持增长。当前标的指数的估值仍然位于历史平均水平区间，因此上市公司盈利的增长有望推动指数点位的增长。

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、交易管理部、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五名投资组合经理。

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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 6,029,209.47 元（每十份基金份额分红 0.5770 元），符合基金合同规定的分红比例。

#### 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

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	13,149,267.70	15,354,503.69
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	164,727,142.40	168,331,435.90
其中：股票投资		164,727,142.40	168,331,435.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	19,049,516.65
应收利息	6.4.3.5	913.60	1,077.82

应收股利		195,027.59	263,946.84
应收申购款		564,191.58	595,009.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	113,915.51	225,970.80
资产总计		178,750,458.38	203,821,461.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,818,948.07	25,041,982.53
应付管理人报酬		143,043.56	176,693.28
应付托管费		35,760.89	44,173.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	92,493.43	327,643.78
负债合计		3,090,245.95	25,590,492.90
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	95,018,873.17	109,198,256.09
未分配利润	6.4.3.10	80,641,339.26	69,032,712.33
所有者权益合计		175,660,212.43	178,230,968.42
负债和所有者权益总计		178,750,458.38	203,821,461.32

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.849 元，基金份额总额 95,018,873.17 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
一、收入		29,087,838.47	3,288,857.40
1. 利息收入		23,737.36	40,903.62
其中：存款利息收入	6.4.3.11	23,737.36	40,903.62

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）		4,524,809.35	8,148,638.99
其中：股票投资收益	6.4.3.12	2,987,993.71	5,555,203.91
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	1,536,815.64	2,593,435.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	24,580,639.31	-5,097,147.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-129,260.89	33,448.16
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	87,913.34	163,013.87
减：二、费用		1,307,246.91	1,818,351.84
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	870,252.02	1,182,830.05
2. 托管费	6.4.6.2.2	217,563.00	295,707.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	18,368.57	54,969.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	201,063.32	284,844.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,780,591.56	1,470,505.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,780,591.56	1,470,505.56

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	109,198,256.09	69,032,712.33	178,230,968.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	27,780,591.56	27,780,591.56
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）	-14,179,382.92	-10,142,755.16	-24,322,138.08
其中：1. 基金申购款	38,525,382.18	28,554,776.64	67,080,158.82
2. 基金赎回款	-52,704,765.10	-38,697,531.80	-91,402,296.90
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）	-	-6,029,209.47	-6,029,209.47
五、期末所有者权益（基金净值）	95,018,873.17	80,641,339.26	175,660,212.43
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	148,919,838.60	111,301,913.96	260,221,752.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,470,505.56	1,470,505.56
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）	-9,149,241.85	-2,693,657.40	-11,842,899.25



其中：1. 基金申购款	85,194,106.53	59,040,564.01	144,234,670.54
2. 基金赎回款	-94,343,348.38	-61,734,221.41	-156,077,569.79
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）	-	-7,341,073.02	-7,341,073.02
五、期末所有者权益（基金净值）	139,770,596.75	102,737,689.10	242,508,285.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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，对金融同业往来利息收

入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	13,149,267.70
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	13,149,267.70

注：于本期末，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,319,714.86 元，折合人民币 9,072,643.75 元(上年度末：活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,729,220.60 元，折合人民币 11,867,986.82 元)。

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,987,662.91	164,727,142.40	19,739,479.49
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	144,987,662.91	164,727,142.40	19,739,479.49

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	913.60
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	-
应收资产支持证券利息	-
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	913.60

#### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	113,915.51
合计	113,915.51

#### 6.4.3.7 应付交易费用

无。

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,594.01
预提费用	83,899.42
合计	92,493.43

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,198,256.09	109,198,256.09
本期申购	38,525,382.18	38,525,382.18
本期赎回（以“-”号填列）	-52,704,765.10	-52,704,765.10
本期末	95,018,873.17	95,018,873.17

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,968,131.01	6,064,581.32	69,032,712.33
本期利润	3,199,952.25	24,580,639.31	27,780,591.56
本期基金份额交易产生的变动数	-7,679,812.44	-2,462,942.72	-10,142,755.16
其中：基金申购款	20,216,421.20	8,338,355.44	28,554,776.64
基金赎回款	-27,896,233.64	-10,801,298.16	-38,697,531.80
本期已分配利润	-6,029,209.47	-	-6,029,209.47
本期末	52,459,061.35	28,182,277.91	80,641,339.26

## 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,737.36
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	-
合计	23,737.36

## 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	45,022,179.06
减：卖出股票成本总额	42,034,185.35
买卖股票差价收入	2,987,993.71

## 6.4.3.13 基金投资收益

无。

## 6.4.3.14 债券投资收益

无。

## 6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

## 6.4.3.16 衍生工具收益

无。

## 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,536,815.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,536,815.64

## 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	24,580,639.31
股票投资	24,580,639.31
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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	24,580,639.31

#### 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	87,913.34
合计	87,913.34

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	18,368.57
银行间市场交易费用	-
合计	18,368.57

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,104.23
指数使用费	27,164.48
银行费用	3,049.14
其他	86,950.28
合计	201,063.32

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。

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金销售机构、基金管理人、注册登记机构
中国银行（香港）有限公司（“中银香港”）	境外资产托管人
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	870,252.02	1,182,830.05
其中：支付销售机构的客户维护费	355,234.65	476,407.00

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 × 1.00% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018
----	--------------------------------	---------------------------------

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	217,563.00	295,707.53

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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,076,992.30	23,737.36	14,160,119.11	40,903.62
中银香港	9,072,275.40	-	2,746,447.44	-

注:本基金的银行存款由基金托管人和境外资产托管人保管,存放于基金托管人的银行存款按银行同业利率计息,存放于境外资产托管人的银行存款不计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。



### 6.4.7 利润分配情况

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
		场内	场外					
1	2019 年 01 月 08 日	-	2019 年 1 月 7 日	0.5770	2,826,145.96	3,203,063.51	6,029,209.47	-
合计	-	-	-	0.5770	2,826,145.96	3,203,063.51	6,029,209.47	-

### 6.4.8 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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,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;在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于本期末,本基金无债券投资(上年度末:同)。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

### 6.4.9.3.1 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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”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。

### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,149,267.70	-	-	-	13,149,267.70
交易性金融资产	-	-	-	-164,727,142.40	164,727,142.40
应收利息	-	-	-	913.60	913.60
应收股利	-	-	-	195,027.59	195,027.59
应收申购款	-	-	-	564,191.58	564,191.58
其他资产	-	-	-	113,915.51	113,915.51
资产总计	13,149,267.70	-	-	-165,601,190.68	178,750,458.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,818,948.07	2,818,948.07
应付管理人报酬	-	-	-	143,043.56	143,043.56
应付托管费	-	-	-	35,760.89	35,760.89
其他负债	-	-	-	92,493.43	92,493.43
负债总计	-	-	-	3,090,245.95	3,090,245.95
利率敏感度缺口	13,149,267.70	-	-	-162,510,944.73	175,660,212.43
上年度末 2018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	3,486,876.84	-	-	11,867,626.85	15,354,503.69
交易性金融资产	-	-	-	-168,331,435.90	168,331,435.90
应收利息	-	-	-	1,077.82	1,077.82
应收股利	-	-	-	263,946.84	263,946.84
应收申购款	-	-	-	595,009.62	595,009.62
应收证券清算款	-	-	-	19,049,516.65	19,049,516.65
其他资产	-	-	-	225,970.80	225,970.80
资产总计	3,486,876.84	-	-	-200,334,584.48	203,821,461.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,041,982.53	25,041,982.53
应付管理人报酬	-	-	-	176,693.28	176,693.28
应付托管费	-	-	-	44,173.31	44,173.31
其他负债	-	-	-	327,643.78	327,643.78
负债总计	-	-	-	25,590,492.90	25,590,492.90
利率敏感度缺口	3,486,876.84	-	-	-174,744,091.58	178,230,968.42

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 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（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位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。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 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	9,072,643.75	-	-	9,072,643.75
交易性金融资产	164,727,142.40	-	-	164,727,142.40
应收股利	195,027.59	-	-	195,027.59
资产合计	173,994,813.74	-	-	173,994,813.74
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	173,994,813.74	-	-	173,994,813.74
项目	上年度末 2018 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	11,867,986.82	-	-	11,867,986.82
交易性金融资产	168,331,435.90	-	-	168,331,435.90
应收股利	263,946.84	-	-	263,946.84
应收证券清算款	19,049,516.65	-	-	19,049,516.65
资产合计	199,512,886.21	-	-	199,512,886.21
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	199,512,886.21	-	-	199,512,886.21

#### 6.4.9.4.2.2 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		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	美元相对人民币升值 5%	8,783,010.00	9,980,000.00
	美元相对人民币贬值 5%	-8,783,010.00	-9,980,000.00

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	164,727,142.40	93.78	168,331,435.90	94.45
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	164,727,142.40	93.78	168,331,435.90	94.45

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)

	动	本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	8,340,000.00	8,380,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-8,340,000.00	-8,380,000.00

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	164,727,142.40	92.15
	其中：普通股	164,727,142.40	92.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,149,267.70	7.36
8	其他各项资产	874,048.28	0.49
9	合计	178,750,458.38	100.00

### 7.2 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	164,727,142.40	93.78
合计	164,727,142.40	93.78

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 7.3.1 期末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 (%)
医疗保健	20,287,720.71	11.55
信息技术	22,757,316.99	12.96
非日常生活消费品	20,296,329.94	11.55
日常消费品	10,441,748.90	5.94
能源	9,856,087.59	5.61
金融	22,164,965.83	12.62
原材料	9,220,344.35	5.25
公用事业	9,176,141.33	5.22
工业	22,899,093.95	13.04
房地产	10,434,556.81	5.94
通信服务	7,192,836.00	4.09
合计	164,727,142.40	93.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

### 7.4 期末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

#### 7.4.1 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	ALLERGAN PLC	艾尔建有限公司	AGN UN	美国纽约证券交易所	美国	401	461,563.44	0.26
2	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	2,083	434,898.40	0.25

				所				
3	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,281	418,748 .63	0.24
4	TECHNIPFMC PLC	TechnipFMC 公 共有限公司	FTI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,224	396,605 .29	0.23
5	FLOWSERVE CORP	福斯公司	FLS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,072	388,308 .35	0.22
6	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国纽约 证券交易 所	美国	880	384,581 .72	0.22
7	APPLIED MATERIALS INC	应用材料股份 有限公司	AMAT UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,243	383,767 .27	0.22
8	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	雅各布工程集 团	JEC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	652	378,261 .67	0.22
9	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控股股 份有限公司	IQV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	341	377,193 .48	0.21
10	Corteva Inc.	Corteva 公司	CTVA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,848	375,670 .46	0.21
11	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	希尔顿全球控 股股份有限公 司	HLT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	556	373,594 .85	0.21
12	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公 司	MPC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	971	373,017 .65	0.21
13	ANSYS INC	ANSYS 股份有 限公司	ANSS UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	264	371,732 .08	0.21
14	TE CONNECTIVITY LTD	泰科电子公司	TEL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	564	371,370 .74	0.21
15	FORD MOTOR CO	福特汽车	F UN	美国纽约 证券交易 所	美国	5,259	369,855 .90	0.21
16	MARTIN MARIETTA MATERIALS	Martin Marietta 材 料股份有限公 司	MLM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	233	368,591 .37	0.21

17	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR UN	美国纽约 证券交易所	美国	375	368,449 .55	0.2 1
18	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限 公司	COO UN	美国纽约 证券交易所	美国	159	368,246 .81	0.2 1
19	HOLLYFRONTIER CORP	HollyFrontie r 公司	HFC UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,15 5	367,476 .09	0.2 1
20	APPLE INC	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	270	367,372 .97	0.2 1
21	T ROWE PRICE GROUP INC	普信集团公司	TROW UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	487	367,306 .77	0.2 1
22	FACEBOOK INC- CLASS A	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	276	366,201 .52	0.2 1
23	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融	PFG UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	918	365,531 .65	0.2 1
24	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	379	365,527 .18	0.2 1
25	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	201	365,158 .35	0.2 1
26	AMETEK INC	阿美特克股份 有限公司	AME UN	美国纽约 证券交易所	美国	583	364,082 .19	0.2 1
27	DARDEN RESTAURANTS INC	达登饭店	DRI UN	美国纽约 证券交易所	美国	434	363,196 .04	0.2 1
28	DAVITA INC	DaVita 股份有 限公司	DVA UN	美国纽约 证券交易所	美国	939	363,177 .61	0.2 1
29	HOME DEPOT INC	家得宝	HD UN	美国纽约 证券交易所	美国	254	363,151 .77	0.2 1
30	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC UN	美国纽约 证券交易所	美国	265	363,138 .50	0.2 1
31	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	江森自控国际 有限公司	JCI UN	美国纽约 证券交易	美国	1,27 7	362,660 .16	0.2 1

				所				
32	ADOBE INC	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	179	362,587 .83	0.2 1
33	TRANSDIGM GROUP INC	TransDigm 集 团公司	TDG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	109	362,531 .80	0.2 1
34	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON UN	美国纽约 证券交易 所	美国	302	362,476 .67	0.2 1
35	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	457	362,462 .30	0.2 1
36	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份 有限公司	ATVI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,11 6	362,126 .20	0.2 1
37	DOVER CORP	多佛	DOV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	525	361,643 .59	0.2 1
38	MOODY'S CORP	穆迪	MCO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	269	361,185 .67	0.2 1
39	ARCONIC INC	奥科宁克股份 有限公司	ARNC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,02 6	359,624 .63	0.2 0
40	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	611	359,599 .81	0.2 0
41	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	423	358,963 .29	0.2 0
42	TRAVELERS COS INC/THE	Travelers 公 司	TRV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	349	358,738 .90	0.2 0
43	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	386	358,665 .20	0.2 0
44	COMCAST CORP- CLASS A	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,23 3	358,386 .64	0.2 0
45	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,08 2	358,257 .53	0.2 0
46	REPUBLIC SERVICES	公共服务公司	RSG UN	美国纽约	美国	601	357,970	0.2

	INC			证券交易 所			.03	0
47	HP INC	惠普	HPQ UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,504	357,884 .23	0.2 0
48	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	277	357,702 .19	0.2 0
49	MID-AMERICA APARTMENT COMM	Mid- America Apar tment Commu nit 公司	MAA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	441	357,018 .02	0.2 0
50	CUMMINS INC	康明斯	CMI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	303	356,907 .06	0.2 0
51	TORCHMARK CORP	Torchmark 公 司	TMK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	580	356,706 .18	0.2 0
52	PROLOGIS INC	普洛斯公司	PLD UN	美国纽约 证券交易 所	美国	647	356,279 .27	0.2 0
53	GARTNER INC	高德纳咨询股 份有限公司	IT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	322	356,265 .38	0.2 0
54	BAKER HUGHES A GE CO	GE 贝克休斯	BHGE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,102	355,918 .76	0.2 0
55	NATIONAL OILWELL VARCO INC	美国国民油井	NOV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,328	355,775 .62	0.2 0
56	NEWMONT MINING CORP	纽蒙特金矿公 司	NEM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,345	355,711 .76	0.2 0
57	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿惠悦 公共有限公司	WLTW UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	270	355,530 .61	0.2 0
58	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	4,923	355,363 .56	0.2 0
59	CITIGROUP INC	花旗集团	C UN	美国纽约 证券交易 所	美国	738	355,299 .21	0.2 0
60	EBAY INC	eBay 公司	EBAY UQ	纳斯达克 证券交易	美国	1,307	354,916 .70	0.2 0

				所				
61	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK UN	美国纽约 证券交易所	美国	384	354,774 .12	0.2 0
62	SYNCHRONY FINANCIAL	同步金融公司	SYF UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,48 8	354,658 .62	0.2 0
63	METLIFE INC	大都会集团	MET UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,03 8	354,442 .07	0.2 0
64	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	473	354,341 .36	0.2 0
65	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	美国纽约 证券交易所	美国	279	354,338 .95	0.2 0
66	PEPSICO INC	百事可乐	PEP UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	393	354,281 .41	0.2 0
67	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY UN	美国纽约 证券交易所	美国	2,90 2	354,119 .23	0.2 0
68	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	677	354,042 .86	0.2 0
69	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊工具	ITW UN	美国纽约 证券交易所	美国	341	353,539 .77	0.2 0
70	EVEREST RE GROUP LTD	安富来集团有 限公司	RE UN	美国纽约 证券交易所	美国	208	353,451 .98	0.2 0
71	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	繁德信息技术 有限公司	FIS UN	美国纽约 证券交易所	美国	419	353,379 .65	0.2 0
72	ENERGY CORP	Entergy 公司	ETR UN	美国纽约 证券交易所	美国	499	353,098 .82	0.2 0
73	H&R BLOCK INC	H&R Block 公 司	HRB UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,75 2	352,903 .10	0.2 0
74	KANSAS CITY SOUTHERN	Kansas City Southern	KSU UN	美国纽约 证券交易所	美国	421	352,577 .38	0.2 0
75	FLIR SYSTEMS INC	FLIR 系统公司	FLIR	纳斯达克	美国	947	352,209	0.2

			UQ	证券交易 所			.44	0
76	PUBLIC STORAGE	公共存储公司	PSA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	215	352,029 .67	0.2 0
77	ONEOK INC	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	744	351,947 .79	0.2 0
78	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百得公 司	SWK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	354	351,929 .23	0.2 0
79	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	503	351,641 .39	0.2 0
80	ARISTA NETWORKS INC	Arista 网络股 份有限公司	ANET UN	美国纽约 证券交易 所	美国	197	351,607 .49	0.2 0
81	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	27	351,489 .73	0.2 0
82	AFLAC INC	家庭人寿保险	AFL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	932	351,179 .75	0.2 0
83	XYLEM INC	赛莱默公司	XYL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	610	350,749 .94	0.2 0
84	MARATHON OIL CORP	Marathon 石油 公司	MRO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	3,58 8	350,509 .88	0.2 0
85	CROWN CASTLE INTL CORP	冠城国际公司	CCI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	391	350,381 .80	0.2 0
86	ROSS STORES INC	Ross 商店有 限公司	ROST UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	514	350,250 .02	0.2 0
87	QUANTA SERVICES INC	Quanta 服务 股份有限公司	PWR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,33 3	349,972 .21	0.2 0
88	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金融股 份有限公司	RJF UN	美国纽约 证券交易 所	美国	602	349,916 .04	0.2 0
89	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融 服务公司	DFS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	656	349,915 .63	0.2 0

90	SEMPRA ENERGY	桑普拉能源	SRE UN	美国纽约 证券交易所	美国	370	349,597 .74	0.2 0
91	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 金融服务	PNC UN	美国纽约 证券交易所	美国	370	349,190 .76	0.2 0
92	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB UN	美国纽约 证券交易所	美国	381	349,095 .07	0.2 0
93	FREEMPORT-MCMORAN INC	自由港迈克默 伦股份有限公司	FCX UN	美国纽约 证券交易所	美国	4,37 3	349,032 .16	0.2 0
94	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG UN	美国纽约 证券交易所	美国	463	349,014 .43	0.2 0
95	FMC CORP	FMC 公司	FMC UN	美国纽约 证券交易所	美国	612	348,996 .90	0.2 0
96	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	307	348,934 .40	0.2 0
97	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	848	348,735 .38	0.2 0
98	BLACKROCK INC	贝莱德有限公 司	BLK UN	美国纽约 证券交易所	美国	108	348,440 .04	0.2 0
99	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD UN	美国纽约 证券交易所	美国	244	348,334 .45	0.2 0
10 0	CELANESE CORP-SER A	塞拉尼斯公司	CE UN	美国纽约 证券交易所	美国	470	348,313 .55	0.2 0
10 1	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX UN	美国纽约 证券交易所	美国	751	348,031 .07	0.2 0
10 2	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股 股份有限公司	BKNG UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	27	347,977 .86	0.2 0
10 3	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX UN	美国纽约 证券交易所	美国	618	347,957 .44	0.2 0
10 4	CIMAREX ENERGY CO	Cimarex 能源 公司	XEC UN	美国纽约 证券交易	美国	853	347,918 .19	0.2 0



				所				
10 5	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公 司	NEE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	247	347,862 .71	0.2 0
10 6	EVERGY INC	Evergy Inc 公 司	EVRG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	841	347,764 .61	0.2 0
10 7	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	Huntington Ingalls 工业 公司	HII UN	美国纽约 证券交易 所	美国	225	347,629 .52	0.2 0
10 8	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF UN	美国纽约 证券交易 所	美国	557	347,462 .32	0.2 0
10 9	BORGWARNER INC	博格华纳股份 有限公司	BWA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,20 3	347,185 .69	0.2 0
11 0	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	542	347,122 .30	0.2 0
11 1	DUKE REALTY CORP	杜克房地产公 司	DRE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,59 7	347,042 .90	0.2 0
11 2	WELLTOWER INC	Welltower 股 份有限公司	WELL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	619	346,945 .97	0.2 0
11 3	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	是德科技公司	KEYS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	561	346,370 .83	0.2 0
11 4	BROADCOM INC	博通股份有限 公司	AVGO UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	175	346,316 .45	0.2 0
11 5	CHUBB LTD	安达保险有限 公司	CB UN	美国纽约 证券交易 所	美国	342	346,300 .50	0.2 0
11 6	SNAP-ON INC	Snap-On 公司	SNA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	304	346,172 .49	0.2 0
11 7	KIMCO REALTY CORP	Kimco 房地产 公司	KIM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,72 4	346,069 .10	0.2 0
11 8	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,45 9	345,873 .99	0.2 0
11	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集团股	EXPE	纳斯达克	美国	378	345,696	0.2

9		份有限公司	UQ	证券交易 所			.63	0
12 0	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	445	345,296 .59	0.2 0
12 1	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团 股份有限公司	WEC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	602	345,032 .53	0.2 0
12 2	AUTODESK INC	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	308	344,925 .70	0.2 0
12 3	STRYKER CORP	史赛克	SYK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	244	344,845 .40	0.2 0
12 4	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然 资源公司	PXD UN	美国纽约 证券交易 所	美国	326	344,823 .68	0.2 0
12 5	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	437	344,767 .03	0.2 0
12 6	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	843	344,766 .69	0.2 0
12 7	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	305	344,354 .75	0.2 0
12 8	IHS MARKIT LTD	IHS Markit 有 限公司	INFO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	785	343,873 .87	0.2 0
12 9	TAPESTRY INC	TPR-DRS-RS 公 司	TPR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,57 6	343,779 .55	0.2 0
13 0	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森	AVY UN	美国纽约 证券交易 所	美国	432	343,554 .61	0.2 0
13 1	PVH CORP	PVH 公司	PVH UN	美国纽约 证券交易 所	美国	528	343,528 .21	0.2 0
13 2	PACCAR INC	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	697	343,370 .78	0.2 0
13 3	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	446	342,791 .79	0.2 0

134	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX UN	美国纽约证券交易所	美国	1,160	342,750.54	0.20
135	BALL CORP	波尔	BLL UN	美国纽约证券交易所	美国	712	342,586.10	0.20
136	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	美国纽约证券交易所	美国	1,065	341,989.86	0.19
137	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克证券交易所	美国	517	341,809.33	0.19
138	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达克证券交易所	美国	135	341,674.31	0.19
139	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN UN	美国纽约证券交易所	美国	1,428	341,634.09	0.19
140	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE UN	美国纽约证券交易所	美国	1,147	341,590.37	0.19
141	AT&T INC	美国电话电报公司	T UN	美国纽约证券交易所	美国	1,482	341,410.11	0.19
142	INTUIT INC	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克证券交易所	美国	190	341,347.42	0.19
143	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	美国纽约证券交易所	美国	2,378	341,347.00	0.19
144	CARDINAL HEALTH INC	康德乐公司	CAH UN	美国纽约证券交易所	美国	1,054	341,283.48	0.19
145	DXC TECHNOLOGY CO	DXC 技术公司	DXC UN	美国纽约证券交易所	美国	900	341,225.73	0.19
146	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	美国纽约证券交易所	美国	170	341,178.30	0.19
147	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT UN	美国纽约证券交易所	美国	590	341,115.74	0.19
148	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信金融集团	PRU UN	美国纽约证券交易所	美国	491	340,923.25	0.19

				所				
14 9	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,178	340,488 .22	0.1 9
15 0	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣威威廉斯	SHW UN	美国纽约 证券交易 所	美国	108	340,265 .48	0.1 9
15 1	HCP INC	HCP 公司	HCP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,547	340,112 .45	0.1 9
15 2	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,734	339,979 .21	0.1 9
15 3	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	868	339,953 .64	0.1 9
15 4	MONSTER BEVERAGE CORP	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	774	339,640 .57	0.1 9
15 5	Atmos Energy Corp	美国阿特摩斯 能源公司	ATO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	468	339,624 .48	0.1 9
15 6	CSX CORP	CSX 公司	CSX UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	638	339,349 .35	0.1 9
15 7	UNITED RENTALS INC	联合租赁公司	URI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	372	339,186 .42	0.1 9
15 8	WATERS CORP	沃特世公司	WAT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	229	338,853 .69	0.1 9
15 9	AMERICAN ELECTRIC POWER	美国电力	AEP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	560	338,823 .71	0.1 9
16 0	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	Fortune Brands 家庭与 安全	FBHS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	862	338,551 .89	0.1 9
16 1	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	687	338,491 .60	0.1 9
16 2	FISERV INC	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	540	338,416 .73	0.1 9
16	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX	纳斯达克	美国	134	338,378	0.1

3			UQ	证券交易 所			.78	9
16 4	DOLLAR TREE INC	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	458	338,129 .51	0.1 9
16 5	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,27 6	337,989 .68	0.1 9
16 6	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	LNC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	762	337,622 .70	0.1 9
16 7	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,86 4	337,532 .37	0.1 9
16 8	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	897	337,498 .34	0.1 9
16 9	MERCK & CO. INC.	默克	MRK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	585	337,219 .50	0.1 9
17 0	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	847	337,202 .45	0.1 9
17 1	FIRSTENERGY CORP	第一能源	FE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,14 5	336,980 .26	0.1 9
17 2	WESTERN UNION CO	西联汇款	WU UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,46 4	336,921 .90	0.1 9
17 3	Ancor plc	Ancor PLC 公 司	AMCR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	4,26 1	336,577 .68	0.1 9
17 4	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	716	336,438 .19	0.1 9
17 5	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,13 4	336,237 .59	0.1 9
17 6	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	393	336,206 .65	0.1 9
17 7	WILLIAMS COS INC	威廉姆斯公司	WMB UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,74 2	335,799 .40	0.1 9

178	CONSTELLATION BRANDS INC-A	星座公司	STZ UN	美国纽约证券交易所	美国	248	335,768.05	0.19
179	JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	杰富瑞金融集团	JEF UN	美国纽约证券交易所	美国	2,539	335,657.02	0.19
180	HUMANA INC	Humana 公司	HUM UN	美国纽约证券交易所	美国	184	335,589.86	0.19
181	EXTRA SPACE STORAGE INC	额外空间仓储公司	EXR UN	美国纽约证券交易所	美国	460	335,526.61	0.19
182	BOEING CO/THE	波音	BA UN	美国纽约证券交易所	美国	134	335,329.58	0.19
183	IPG PHOTONICS CORP	IPG 光子公司	IPGP UQ	纳斯达克证券交易所	美国	316	335,093.50	0.19
184	ASSURANT INC	艾斯兰公司	AIZ UN	美国纽约证券交易所	美国	458	334,949.41	0.19
185	CME GROUP INC-CL A	芝加哥商业交易所集团	CME UQ	纳斯达克证券交易所	美国	251	334,946.45	0.19
186	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD UN	美国纽约证券交易所	美国	58	334,935.38	0.19
187	DEERE & CO	迪尔	DE UN	美国纽约证券交易所	美国	294	334,926.72	0.19
188	HELMERICH & PAYNE	Helmerich & Payne Inc 公司	HP UN	美国纽约证券交易所	美国	962	334,773.42	0.19
189	CADENCE DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	687	334,429.89	0.19
190	EVERSOURCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES UN	美国纽约证券交易所	美国	642	334,371.11	0.19
191	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNPR UN	美国纽约证券交易所	美国	1,826	334,291.77	0.19
192	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR UN	美国纽约证券交易所	美国	640	334,033.42	0.19

				所				
19 3	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	728	334,019 .12	0.1 9
19 4	KLA CORP	Kla-Tencor 公 司	KLAC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	411	333,974 .30	0.1 9
19 5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AvalonBay 社 区股份有限公 司	AVB UN	美国纽约 证券交易 所	美国	239	333,835 .57	0.1 9
19 6	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	891	333,770 .74	0.1 9
19 7	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	341	333,730 .66	0.1 9
19 8	BEST BUY CO INC	百思买	BBY UN	美国纽约 证券交易 所	美国	696	333,643 .49	0.1 9
19 9	ALLEGION PLC	安朗杰公共有 限公司	ALLE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	439	333,639 .16	0.1 9
20 0	INCYTE CORP	Incyte 有限 公司	INCY UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	571	333,506 .55	0.1 9
20 1	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,10 7	333,406 .93	0.1 9
20 2	CONCHO RESOURCES INC	康丘资源公司	CXO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	470	333,385 .83	0.1 9
20 3	Alliant Energy Corp	Alliant 能源 公司	LNT UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	988	333,361 .35	0.1 9
20 4	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	379	333,192 .79	0.1 9
20 5	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普格鲁 门公司	NOC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	150	333,192 .65	0.1 9
20 6	OMNICOM GROUP	奥姆尼康	OMC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	591	332,958 .56	0.1 9
20	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU UN	美国纽约	美国	684	332,546	0.1

7				证券交易所			.29	9
208	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM UN	美国纽约证券交易所	美国	1,693	332,522.43	0.19
209	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB UN	美国纽约证券交易所	美国	1,207	332,491.36	0.19
210	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMX UN	美国纽约证券交易所	美国	557	332,490.12	0.19
211	3M CO	3M 公司	MMM UN	美国纽约证券交易所	美国	279	332,473.28	0.19
212	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	美国纽约证券交易所	美国	290	332,403.43	0.19
213	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT UN	美国纽约证券交易所	美国	133	332,397.38	0.19
214	AMERISOURCEBERGEN CORP	美源伯根	ABC UN	美国纽约证券交易所	美国	567	332,339.63	0.19
215	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	477	332,055.02	0.19
216	MOLSON COORS BREWING CO -B	莫尔森-康胜	TAP UN	美国纽约证券交易所	美国	862	331,855.52	0.19
217	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验控股	LH UN	美国纽约证券交易所	美国	279	331,629.34	0.19
218	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Vertex 制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	263	331,559.49	0.19
219	WABTEC CORP/DE	西屋制动公司	WAB UN	美国纽约证券交易所	美国	672	331,516.73	0.19
220	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	味好美股份有限公司	MKC UN	美国纽约证券交易所	美国	311	331,416.29	0.19
221	PPG INDUSTRIES INC	PPG 工业	PPG UN	美国纽约证券交易所	美国	413	331,369.00	0.19



22 2	BB&T CORP	BB&T 公司	BBT UN	美国纽约 证券交易所	美国	981	331,336 .68	0.1 9
22 3	VULCAN MATERIALS CO	Vulcan 材料	VMC UN	美国纽约 证券交易所	美国	351	331,331 .74	0.1 9
22 4	ABIOMED INC	Abiomed 股份 有限公司	ABMD UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	185	331,296 .26	0.1 9
22 5	EXPEDITORS INTL WASH INC	华盛顿康捷国 际物流公司	EXPD UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	635	331,161 .86	0.1 9
22 6	Capri Holdings Ltd	Capri 控股有 限公司	CPRI UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,38 9	331,157 .87	0.1 9
22 7	COMERICA INC	联信银行股份 有限公司	CMA UN	美国纽约 证券交易所	美国	663	331,087 .75	0.1 9
22 8	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	雅诗兰黛	EL UN	美国纽约 证券交易所	美国	263	331,071 .32	0.1 9
22 9	AMEREN CORPORATION	阿曼瑞恩公司	AEE UN	美国纽约 证券交易所	美国	641	330,985 .94	0.1 9
23 0	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	环球健康服务 公司	UHS UN	美国纽约 证券交易所	美国	369	330,768 .70	0.1 9
23 1	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT UN	美国纽约 证券交易所	美国	353	330,744 .36	0.1 9
23 2	US BANCORP	美国合众银行	USB UN	美国纽约 证券交易所	美国	918	330,695 .07	0.1 9
23 3	RESMED INC	瑞思迈股份有 限公司	RMD UN	美国纽约 证券交易所	美国	394	330,534 .34	0.1 9
23 4	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH UN	美国纽约 证券交易所	美国	197	330,466 .62	0.1 9
23 5	EATON CORP PLC	伊顿	ETN UN	美国纽约 证券交易所	美国	577	330,346 .93	0.1 9
23 6	PERRIGO CO PLC	Perrigo 公司	PRGO UN	美国纽约 证券交易	美国	1,00 9	330,319 .57	0.1 9

				所				
23 7	UNITED TECHNOLOGIES CORP	联合技术	UTX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	369	330,286 .71	0.1 9
23 8	FASTENAL CO	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,47 4	330,244 .50	0.1 9
23 9	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理仕	CBRE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	936	330,101 .09	0.1 9
24 0	Teleflex Inc	泰利福公司	TFX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	145	330,100 .75	0.1 9
24 1	SYNOPSYS INC	新思科技公司	SNPS UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	373	329,995 .02	0.1 9
24 2	TEXTRON INC	德事隆	TXT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	905	329,993 .85	0.1 9
24 3	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品公司	APD UN	美国纽约 证券交易 所	美国	212	329,919 .88	0.1 9
24 4	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	FITB UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,71 9	329,711 .30	0.1 9
24 5	XEROX CORP	施乐	XRX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,35 3	329,365 .02	0.1 9
24 6	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	Take-Two 互动 软件股份有限 公司	TTWO UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	422	329,364 .54	0.1 9
24 7	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	234	329,135 .89	0.1 9
24 8	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公 司	TMO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	163	329,090 .79	0.1 9
24 9	DENTSPLY SIRONA INC	登士柏西诺德 公司	XRAY UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	820	328,990 .14	0.1 9
25 0	UDR INC	UDR 公司	UDR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,06 6	328,973 .23	0.1 9

25 1	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,01 5	328,794 .90	0.1 9
25 2	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	904	328,634 .86	0.1 9
25 3	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份 有限公司	MCHP UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	551	328,416 .11	0.1 9
25 4	LEGGETT & PLATT INC	礼恩派	LEG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,24 5	328,408 .89	0.1 9
25 5	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	FleetCor 技术 公司	FLT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	170	328,229 .11	0.1 9
25 6	AMGEN INC	安进公司	AMGN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	259	328,119 .26	0.1 9
25 7	HCA HEALTHCARE INC	HCA 医疗保健 有限公司	HCA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	353	328,026 .38	0.1 9
25 8	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion 制药 公司	ALXN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	364	327,763 .15	0.1 9
25 9	ZOETIS INC-CL A	硕腾股份有限 公司	ZTS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	420	327,688 .08	0.1 9
26 0	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	公寓投资与管 理	AIV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	951	327,676 .53	0.1 9
26 1	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公 司	TSCO UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	438	327,609 .70	0.1 9
26 2	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有 限公司	IDXX UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	173	327,456 .33	0.1 9
26 3	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	189	327,441 .20	0.1 9
26 4	ADVANCE AUTO PARTS INC	领先汽车配件 公司	AAP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	309	327,436 .87	0.1 9
26 5	DISH NETWORK CORP-A	DISH 网络公司	DISH UQ	纳斯达克 证券交易	美国	1,24 0	327,430 .96	0.1 9

				所				
26 6	EQUIFAX INC	Equifax 公司	EFX UN	美国纽约 证券交易所	美国	352	327,266 .52	0.1 9
26 7	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股 份有限公司	REGN UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	152	327,070 .73	0.1 9
26 8	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威股份 有限公司	CHD UN	美国纽约 证券交易所	美国	651	326,974 .89	0.1 9
26 9	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V UN	美国纽约 证券交易所	美国	274	326,910 .55	0.1 9
27 0	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯克希尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	美国纽约 证券交易所	美国	223	326,802 .00	0.1 9
27 1	VF CORP	VF 公司	VFC UN	美国纽约 证券交易所	美国	544	326,674 .74	0.1 9
27 2	LOEWS CORP	罗斯	L UN	美国纽约 证券交易所	美国	869	326,604 .83	0.1 9
27 3	RED HAT INC	红帽公司	RHT UN	美国纽约 证券交易所	美国	253	326,570 .80	0.1 9
27 4	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,63 8	326,562 .00	0.1 9
27 5	WYNN RESORTS LTD	永利度假村有 限公司	WYNN UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	383	326,466 .92	0.1 9
27 6	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY UN	美国纽约 证券交易所	美国	944	326,302 .96	0.1 9
27 7	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公 司	AKAM UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	592	326,155 .57	0.1 9
27 8	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW UN	美国纽约 证券交易所	美国	470	326,051 .21	0.1 9
27 9	PERKINELMER INC	珀金埃尔默	PKI UN	美国纽约 证券交易所	美国	492	325,855 .83	0.1 9
28	CORNING INC	康宁公司	GLW UN	美国纽约	美国	1,42	325,535	0.1

0				证券交易 所		5	.95	9
28 1	MASTERCARD INC – A	万事达股份有 限公司	MA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	179	325,523 .03	0.1 9
28 2	AMPHENOL CORP-CL A	安费诺公司	APH UN	美国纽约 证券交易 所	美国	493	325,162 .45	0.1 9
28 3	L BRANDS INC	蕾碧裳股份有 限公司	LB UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,81 2	325,126 .56	0.1 9
28 4	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务企业 集团	PEG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	804	325,113 .36	0.1 9
28 5	MARSH & MCLENNAN COS	Marsh & McLennan 股份 有限公司	MMC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	474	325,046 .13	0.1 9
28 6	O’REILLY AUTOMOTIVE INC	O’Reilly 汽 车股份有限公 司	ORLY UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	128	324,987 .42	0.1 9
28 7	VERISIGN INC	威瑞信股份有 限公司	VRSN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	226	324,968 .17	0.1 8
28 8	INGERSOLL-RAND PLC	英格索兰	IR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	373	324,815 .21	0.1 8
28 9	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX UN	美国纽约 证券交易 所	美国	505	324,745 .02	0.1 8
29 0	CERNER CORP	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	644	324,521 .59	0.1 8
29 1	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	983	324,511 .00	0.1 8
29 2	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福德金融 服务	HIG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	847	324,450 .37	0.1 8
29 3	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	279	324,359 .96	0.1 8
29 4	WALMART INC	沃尔玛股份有 限公司	WMT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	427	324,343 .05	0.1 8

29 5	DELTA AIR LINES INC	达美航空有限 公司	DAL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	831	324,205 .70	0.1 8
29 6	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	207	324,159 .50	0.1 8
29 7	ROBERT HALF INTL INC	罗致恒富国际 公司	RHI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	827	324,123 .34	0.1 8
29 8	STATE STREET CORP	道富集团	STT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	841	324,117 .77	0.1 8
29 9	MASCO CORP	马斯可	MAS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,20 1	323,985 .64	0.1 8
30 0	ALASKA AIR GROUP INC	阿拉斯加航空 集团公司	ALK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	737	323,809 .85	0.1 8
30 1	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	548	323,764 .82	0.1 8
30 2	NEWELL BRANDS INC	纽威尔品牌公 司	NWL UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,05 4	323,748 .05	0.1 8
30 3	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD UN	美国纽约 证券交易 所	美国	259	323,739 .11	0.1 8
30 4	AON PLC	怡安保险	AON UN	美国纽约 证券交易 所	美国	244	323,709 .82	0.1 8
30 5	COPART INC	Copart 股份 有限公司	CPRT UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	630	323,703 .50	0.1 8
30 6	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI UN	美国纽约 证券交易 所	美国	197	323,397 .09	0.1 8
30 7	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比海 游轮有限公司	RCL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	388	323,313 .57	0.1 8
30 8	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份 有限公司	NRG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,33 9	323,287 .44	0.1 8
30 9	MICROSOFT CORP	微软	MSFT UQ	纳斯达克 证券交易	美国	351	323,248 .12	0.1 8

				所				
310	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿纳达科石油	APC UN	美国纽约证券交易所	美国	666	323,062.50	0.18
311	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	亚历山大房地产股份有限公司	ARE UN	美国纽约证券交易所	美国	333	322,993.82	0.18
312	NISOURCE INC	NiSource 公司	NI UN	美国纽约证券交易所	美国	1,630	322,725.92	0.18
313	YUM! BRANDS INC	百胜全球餐饮	YUM UN	美国纽约证券交易所	美国	424	322,588.97	0.18
314	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC UN	美国纽约证券交易所	美国	453	322,572.89	0.18
315	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN UN	美国纽约证券交易所	美国	293	322,547.79	0.18
316	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	美国纽约证券交易所	美国	454	322,317.42	0.18
317	LYONDELLBASELL INDU-CL A	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	美国纽约证券交易所	美国	544	322,112.14	0.18
318	VIACOM INC-CLASS B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	1,568	321,984.55	0.18
319	QUEST DIAGNOSTICS INC	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX UN	美国纽约证券交易所	美国	460	321,960.08	0.18
320	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	全系统服务公司	TSS UN	美国纽约证券交易所	美国	365	321,863.49	0.18
321	XILINX INC	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	397	321,833.86	0.18
322	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ UN	美国纽约证券交易所	美国	336	321,722.76	0.18
323	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM UN	美国纽约证券交易所	美国	339	321,379.16	0.18
32	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS	纳斯达克	美国	197	321,365	0.1

4			UQ	证券交易 所			.62	8
32 5	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公 司	VRSK UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	319	321,191 .07	0.1 8
32 6	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	瓦里安医疗设 备有限公司	VAR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	343	320,997 .55	0.1 8
32 7	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术 公司	ISRG UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	89	320,945 .03	0.1 8
32 8	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	联合数据系统 公司	ADS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	333	320,796 .12	0.1 8
32 9	CITIZENS FINANCIAL GROUP	公民金融集团	CFG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,31 9	320,634 .91	0.1 8
33 0	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	查特通信公司	CHTR UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	118	320,575 .79	0.1 8
33 1	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公司	O UN	美国纽约 证券交易 所	美国	675	320,049 .94	0.1 8
33 2	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	478	320,033 .92	0.1 8
33 3	CINCINNATI FINANCIAL CORP	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	449	320,002 .37	0.1 8
33 4	DuPont de Nemours Inc.	陶氏杜邦	DD UN	美国纽约 证券交易 所	美国	620	319,971 .91	0.1 8
33 5	ROPER TECHNOLOGIES INC	Roper 科技股 份有限公司	ROP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	127	319,776 .81	0.1 8
33 6	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	873	319,765 .95	0.1 8
33 7	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔 有限公司	AJG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	531	319,744 .29	0.1 8
33 8	FORTIVE CORP	福迪威公司	FTV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	570	319,442 .56	0.1 8



339	SUNTRUST BANKS INC	太阳信托银行	STI UN	美国纽约证券交易所	美国	739	319,303.35	0.18
340	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB UN	美国纽约证券交易所	美国	273	319,186.20	0.18
341	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE UN	美国纽约证券交易所	美国	553	319,153.48	0.18
342	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲公司	ACN UN	美国纽约证券交易所	美国	251	318,829.82	0.18
343	APTIV PLC	Aptiv 公共有限公司	APT UN	美国纽约证券交易所	美国	573	318,405.79	0.18
344	KOHL'S CORP	Kohl's 公司	KSS UN	美国纽约证券交易所	美国	974	318,392.79	0.18
345	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	552	318,120.97	0.18
346	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB UN	美国纽约证券交易所	美国	657	318,019.29	0.18
347	HARLEY-DAVIDSON INC	哈雷摩托车	HOG UN	美国纽约证券交易所	美国	1,290	317,753.45	0.18
348	SOUTHERN CO/THE	南方公司	SO UN	美国纽约证券交易所	美国	836	317,707.94	0.18
349	ECOLAB INC	艺康化工	ECL UN	美国纽约证券交易所	美国	234	317,617.74	0.18
350	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO UN	美国纽约证券交易所	美国	907	317,504.17	0.18
351	WELLCARE HEALTH PLANS INC	WellCare 健康计划股份有限公司	WCG UN	美国纽约证券交易所	美国	162	317,482.86	0.18
352	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX UN	美国纽约证券交易所	美国	244	317,251.73	0.18
353	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克证券交易所	美国	683	317,222.58	0.18

				所				
35 4	PINNACLE WEST CAPITAL	Pinnacle 西 部资本	PNW UN	美国纽约 证券交易 所	美国	490	316,951 .86	0.1 8
35 5	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBAC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	205	316,870 .05	0.1 8
35 6	L3 TECHNOLOGIES INC	L3 科技股份有 限公司	LLL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	188	316,868 .40	0.1 8
35 7	ELI LILLY & CO	礼来	LLY UN	美国纽约 证券交易 所	美国	416	316,845 .57	0.1 8
35 8	KELLOGG CO	家乐氏	K UN	美国纽约 证券交易 所	美国	860	316,718 .80	0.1 8
35 9	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地产信 托有限公司	DLR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	391	316,620 .43	0.1 8
36 0	HUNTINGTON BANCSHARES INC	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,33 2	316,567 .84	0.1 8
36 1	NOBLE ENERGY INC	Noble 能源股 份有限公司	NBL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,05 5	316,456 .19	0.1 8
36 2	CITRIX SYSTEMS INC	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	469	316,426 .35	0.1 8
36 3	GAP INC/THE	盖璞公司	GPS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,56 1	316,381 .74	0.1 8
36 4	LINDE PLC	Linde 公司	LIN UN	美国纽约 证券交易 所	美国	229	316,120 .71	0.1 8
36 5	COTY INC-CL A	科蒂集团	COTY UN	美国纽约 证券交易 所	美国	3,42 9	315,882 .84	0.1 8
36 6	BOSTON PROPERTIES INC	波士顿地产公 司	BXP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	356	315,713 .72	0.1 8
36 7	HOST HOTELS & RESORTS INC	Host 酒店及度 假股份有限公 司	HST UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,52 0	315,647 .73	0.1 8
36	EMERSON ELECTRIC	艾默生电气	EMR UN	美国纽约	美国	688	315,571	0.1

8	CO			证券交易所			.83	8
369	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT UN	美国纽约 证券交易所	美国	530	315,571 .42	0.1 8
370	E*TRADE FINANCIAL CORP	亿创证券有限 公司	ETFC UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,029	315,503 .36	0.1 8
371	EQUINIX INC	Equinix 有限 公司	EQIX UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	91	315,482 .66	0.1 8
372	TYSON FOODS INC- CL A	泰森食品公司	TSN UN	美国纽约 证券交易所	美国	568	315,275 .94	0.1 8
373	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED UN	美国纽约 证券交易所	美国	523	315,250 .64	0.1 8
374	BROWN-FORMAN CORP-CL B (NON- VOTING SHARES)	布朗福曼	BF/B UN	美国纽约 证券交易所	美国	827	315,140 .44	0.1 8
375	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公 司	DIS UN	美国纽约 证券交易所	美国	328	314,874 .46	0.1 8
376	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS UN	美国纽约 证券交易所	美国	872	314,843 .66	0.1 8
377	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股 份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	400	314,751 .26	0.1 8
378	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份 有限公司	MU UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,186	314,639 .48	0.1 8
379	HASBRO INC	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	433	314,582 .42	0.1 8
380	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	挪威邮轮控股 有限公司	NCLH UN	美国纽约 证券交易所	美国	853	314,492 .71	0.1 8
381	RAYTHEON COMPANY	雷神公司	RTN UN	美国纽约 证券交易所	美国	263	314,383 .06	0.1 8
382	NORTHERN TRUST CORP	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	508	314,311 .28	0.1 8

38 3	ANTHEM INC	Anthem 股份有 限公司	ANTM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	162	314,297 .67	0.1 8
38 4	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	341	313,945 .00	0.1 8
38 5	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	653	313,793 .62	0.1 8
38 6	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	952	313,753 .61	0.1 8
38 7	NIELSEN HOLDINGS PLC	尼尔森控股公 开有限公司	NLSN UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,01 9	313,688 .44	0.1 8
38 8	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	846	313,482 .20	0.1 8
38 9	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,46 9	313,470 .92	0.1 8
39 0	AMERICAN WATER WORKS CO INC	美国自来水股 份有限公司	AWK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	393	313,403 .82	0.1 8
39 1	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	布罗德里奇金 融解决方	BR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	357	313,360 .93	0.1 8
39 2	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	哥伦比亚广播 公司	CBS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	913	313,202 .39	0.1 8
39 3	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,14 6	313,087 .86	0.1 8
39 4	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,01 6	313,083 .74	0.1 8
39 5	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集 团公司	SPG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	285	313,016 .09	0.1 8
39 6	TIFFANY & CO	蒂芙尼	TIF UN	美国纽约 证券交易 所	美国	486	312,861 .00	0.1 8
39 7	NORDSTROM INC	诺德斯特龙公 司	JWN UN	美国纽约 证券交易	美国	1,42 8	312,771 .90	0.1 8

				所				
39 8	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容产品 公司	ULTA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	131	312,404 .17	0.1 8
39 9	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份有 限公司	CMG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	62	312,376 .47	0.1 8
40 0	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	IFF UN	美国纽约 证券交易 所	美国	313	312,201 .92	0.1 8
40 1	PROGRESSIVE CORP	前进保险公司	PGR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	568	312,113 .03	0.1 8
40 2	PPL CORP	PPL 公司	PPL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,46 4	312,102 .03	0.1 8
40 3	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾	PH UN	美国纽约 证券交易 所	美国	267	312,060 .99	0.1 8
40 4	WESTROCK CO	Westrock 公司	WRK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,24 4	311,896 .06	0.1 8
40 5	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石 油	XOM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	592	311,870 .49	0.1 8
40 6	FOOT LOCKER INC	富乐客公司	FL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,08 0	311,242 .42	0.1 8
40 7	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	567	311,056 .80	0.1 8
40 8	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方 案公司	SWKS UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	585	310,756 .72	0.1 8
40 9	SYMANTEC CORP	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,07 7	310,705 .64	0.1 8
41 0	MACERICH CO/THE	Macerich 公 司	MAC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,34 8	310,355 .03	0.1 8
41 1	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN UN	美国纽约 证券交易 所	美国	580	310,333 .58	0.1 8

41 2	CENTURYLINK INC	世纪电信公司	CTL UN	美国纽约 证券交易所	美国	3,83 4	309,965 .37	0.1 8
41 3	AUTOZONE INC	AutoZone 公司	AZO UN	美国纽约 证券交易所	美国	41	309,899 .58	0.1 8
41 4	HERSHEY CO/THE	好时食品	HSY UN	美国纽约 证券交易所	美国	336	309,595 .79	0.1 8
41 5	NETAPP INC	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	729	309,219 .19	0.1 8
41 6	AMERICAN TOWER CORP-CL A	美国发射塔公 司	AMT UN	美国纽约 证券交易所	美国	220	309,217 .13	0.1 8
41 7	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业 股份有限公司	MHK UN	美国纽约 证券交易所	美国	305	309,212 .66	0.1 8
41 8	TWITTER INC	推特公司	TWTR UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,28 8	309,026 .01	0.1 8
41 9	SEALED AIR CORP	希悦尔包装	SEE UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,05 0	308,804 .65	0.1 8
42 0	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信 股份有限公司	VZ UN	美国纽约 证券交易所	美国	785	308,310 .01	0.1 8
42 1	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	人民联合金融 股份有限公司	PBCT UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	2,67 2	308,235 .15	0.1 8
42 2	FEDEX CORP	联邦快递	FDX UN	美国纽约 证券交易所	美国	273	308,150 .66	0.1 8
42 3	PULTEGROUP INC	Pulte 集团公 司	PHM UN	美国纽约 证券交易所	美国	1,41 7	308,024 .65	0.1 8
42 4	Cboe Global Markets, Inc	Cboe 环球市场 公司	CBOE UF	巴兹全球 市场	美国	432	307,767 .67	0.1 8
42 5	SALESFORCE.COM INC	Salesforce.c om 股份有限 公司	CRM UN	美国纽约 证券交易所	美国	295	307,713 .98	0.1 8
42 6	INTEL CORP	英特尔	INTC UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	935	307,700 .92	0.1 8

42 7	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公司	PKG UN	美国纽约 证券交易所	美国	469	307,334 .01	0.1 7
42 8	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	联合大陆控股 公司	UAL UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	510	306,958 .79	0.1 7
42 9	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC UN	美国纽约 证券交易所	美国	943	306,768 .09	0.1 7
43 0	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,67 6	306,600 .35	0.1 7
43 1	CELGENE CORP	新基医药	CELG UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	482	306,309 .68	0.1 7
43 2	QORVO INC	Qorvo 股份有 限公司	QRVO UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	668	305,893 .08	0.1 7
43 3	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空	LUV UN	美国纽约 证券交易所	美国	876	305,809 .21	0.1 7
43 4	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMJ UN	美国纽约 证券交易所	美国	979	305,220 .52	0.1 7
43 5	HANESBRANDS INC	汉佰有限公司	HBI UN	美国纽约 证券交易所	美国	2,57 8	305,189 .66	0.1 7
43 6	ZIONS BANCORP NA	Zions 公司	ZION UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	963	304,403 .05	0.1 7
43 7	CIGNA CORP	信诺集团	CI UN	美国纽约 证券交易所	美国	281	304,353 .62	0.1 7
43 8	REGIONS FINANCIAL CORP	地区金融公司	RF UN	美国纽约 证券交易所	美国	2,96 3	304,323 .86	0.1 7
43 9	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	537	303,791 .14	0.1 7
44 0	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团 公司	AAL UQ	纳斯达克 证券交易所	美国	1,35 4	303,545 .09	0.1 7
44 1	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天 然气公司	COG UN	美国纽约 证券交易	美国	1,92 2	303,374 .46	0.1 7

				所				
44 2	DOMINION ENERGY INC	Dominion 能源 公司	D UN	美国纽约 证券交易 所	美国	570	302,984 .53	0.1 7
44 3	FEDERAL REALTY INVS TRUST	联邦房地产投 资信托公司	FRT UN	美国纽约 证券交易 所	美国	342	302,733 .74	0.1 7
44 4	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱斯金 融公司	AMP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	303	302,373 .23	0.1 7
44 5	First Republic Bank	第一共和银行	FRC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	450	302,091 .50	0.1 7
44 6	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A UN	美国纽约 证券交易 所	美国	588	301,840 .30	0.1 7
44 7	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	捷迈邦美控股 股份有限公司	ZBH UN	美国纽约 证券交易 所	美国	372	301,106 .91	0.1 7
44 8	SVB FINANCIAL GROUP	硅谷银行金融 集团	SIVB UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	195	301,077 .83	0.1 7
44 9	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,01 0	300,790 .12	0.1 7
45 0	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	794	300,764 .00	0.1 7
45 1	CENTERPOINT ENERGY INC	中点能源	CNP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,52 8	300,745 .03	0.1 7
45 2	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物 流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	518	300,378 .33	0.1 7
45 3	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理财	SCHW UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,08 7	300,331 .79	0.1 7
45 4	UNUM GROUP	尤那姆集团	UNM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,30 2	300,301 .33	0.1 7
45 5	NEKTAR THERAPEUTICS	内克塔治疗公 司	NKTR UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,22 7	300,126 .44	0.1 7
45	FORTINET INC	飞塔股份有限	FTNT	纳斯达克	美国	568	300,008	0.1



6		公司	UQ	证券交易 所			.06	7
45 7	RALPH LAUREN CORP	Ralph Lauren 公司	RL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	384	299,864 .51	0.1 7
45 8	MACY'S INC	梅西百货	M UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,03 2	299,783 .12	0.1 7
45 9	SMITH (A. O.) CORP	AO 史密斯公 司	AOS UN	美国纽约 证券交易 所	美国	922	298,922 .41	0.1 7
46 0	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC UN	美国纽约 证券交易 所	美国	829	298,862 .18	0.1 7
46 1	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公 司	SJM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	377	298,545 .05	0.1 7
46 2	AES CORP	爱伊斯	AES UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,59 0	298,419 .73	0.1 7
46 3	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE UN	美国纽约 证券交易 所	美国	2,90 0	298,052 .62	0.1 7
46 4	F5 NETWORKS INC	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	297	297,345 .28	0.1 7
46 5	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JB Hunt 运输 服务股份有 限公司	JBHT UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	473	297,240 .92	0.1 7
46 6	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	787	295,785 .96	0.1 7
46 7	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动 化	ROK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	262	295,085 .91	0.1 7
46 8	APACHE CORP	阿帕契	APA UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,48 1	294,956 .05	0.1 7
46 9	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯 国际集团	PM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	543	293,149 .51	0.1 7
47 0	TRIPADVISOR INC	猫途鹰股份有 限公司	TRIP UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	921	293,089 .70	0.1 7

47 1	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	483	292,999 .16	0.1 7
47 2	PENTAIR PLC	Pentair 公共 有限公司	PNR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,14 5	292,820 .97	0.1 7
47 3	LAMB WESTON HOLDINGS INC	蓝威斯顿控股 股份有限公司	LW UN	美国纽约 证券交易 所	美国	670	291,839 .26	0.1 7
47 4	AFFILIATED MANAGERS GROUP	联合经理集团 股份有限公司	AMG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	459	290,746 .60	0.1 7
47 5	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP UN	美国纽约 证券交易 所	美国	693	290,614 .19	0.1 7
47 6	WW GRAINGER INC	固安捷公司	GWV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	157	289,508 .12	0.1 6
47 7	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN UN	美国纽约 证券交易 所	美国	869	289,505 .58	0.1 6
47 8	VORNADO REALTY TRUST	沃那多房地 产信托	VNO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	655	288,637 .72	0.1 6
47 9	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公 司	CTSH UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	661	288,055 .36	0.1 6
48 0	KROGER CO	克罗格公司	KR UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,91 8	286,261 .00	0.1 6
48 1	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股 份有限公司	ALGN UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	152	286,004 .02	0.1 6
48 2	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌 股份有限	CAG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,55 8	284,049 .95	0.1 6
48 3	ARCHER-DANIELS- MIDLAND CO	Archer- Daniels- Midland 公司	ADM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,00 4	281,609 .71	0.1 6
48 4	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有 限公司	HRL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,00 5	280,093 .84	0.1 6
48 5	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX UN	美国纽约 证券交易	美国	266	279,987 .69	0.1 6

				所				
48 6	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行 股份有限公司	BK UN	美国纽约 证券交易 所	美国	920	279,236 .56	0.1 6
48 7	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,12 8	278,159 .71	0.1 6
48 8	SL GREEN REALTY CORP	SL Green 房 地产公司	SLG UN	美国纽约 证券交易 所	美国	501	276,812 .34	0.1 6
48 9	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO UN	美国纽约 证券交易 所	美国	849	276,363 .97	0.1 6
49 0	ABBVIE INC	艾伯维生物制 药公司	ABBV UN	美国纽约 证券交易 所	美国	552	275,960 .36	0.1 6
49 1	IRON MOUNTAIN INC	美国铁山公司	IRM UN	美国纽约 证券交易 所	美国	1,27 9	275,212 .80	0.1 6
49 2	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	美国纽约 证券交易 所	美国	803	272,210 .14	0.1 5
49 3	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	2,90 5	269,408 .84	0.1 5
49 4	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL UN	美国纽约 证券交易 所	美国	795	254,413 .74	0.1 4
49 5	MYLAN NV	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,76 3	230,766 .63	0.1 3
49 6	DISCOVERY INC-C	探索公司	DISCK UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,15 0	224,923 .00	0.1 3
49 7	BIOGEN INC	百健	BIIB UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	139	223,482 .27	0.1 3
49 8	FOX CORP - CLASS A	福克斯	FOXA UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	790	198,992 .32	0.1 1
49 9	ALPHABET INC-CL C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达克 证券交易 所	美国	22	163,480 .50	0.0 9
50	UNDER ARMOUR INC-	安德玛公司	UAA UN	美国纽约	美国	903	157,369	0.0

0	CLASS A			证券交易所			.10	9
501	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克证券交易所	美国	20	148,878.50	0.08
502	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	安德玛公司	UA UN	美国纽约证券交易所	美国	926	141,324.58	0.08
503	DISCOVERY INC - A	探索公司	DISCA UQ	纳斯达克证券交易所	美国	538	113,546.67	0.06
504	FOX CORP- CLASS B	福克斯	FOX UQ	纳斯达克证券交易所	美国	363	91,161.20	0.05
505	NEWS CORP - CLASS B	新闻集团	NWS UQ	纳斯达克证券交易所	美国	938	90,020.62	0.05

#### 7.4.2 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权益投资明细

无。

#### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

##### 7.5.1 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	Atmos Energy Corp	ATO UN	415,611.84	0.23
2	Teleflex Inc	TFX UN	336,220.13	0.19
3	Amcor plc	AMCR UN	322,569.77	0.18
4	First Republic Bank	FRC UN	304,946.80	0.17
5	WABTEC CORP/DE	WAB UN	298,627.30	0.17
6	Corteva Inc.	CTVA UN	269,957.92	0.15
7	Cboe Global Markets, Inc	CBOE UF	255,395.19	0.14
8	DuPont DE Nemours Inc	DD UN	212,264.56	0.12
9	Dow Chemical	DOW UN	176,228.68	0.10
10	FASTENAL CO	FAST UQ	166,569.77	0.09
11	PVH CORP	PVH UN	164,446.48	0.09
12	NATIONAL OILWELL VARCO INC	NOV UN	151,371.57	0.08

13	FOX CORP - CLASS A	FOXA UQ	139,870.30	0.08
14	ACTIVISION BLIZZARD INC	ATVI UQ	139,270.21	0.08
15	ALLERGAN PLC	AGN UN	135,756.55	0.08
16	SVB FINANCIAL GROUP	SIVB UQ	131,995.33	0.07
17	MOSAIC CO/THE	MOS UN	131,690.79	0.07
18	HENRY SCHEIN INC	HSIC UQ	129,033.79	0.07
19	NORDSTROM INC	JWN UN	124,054.03	0.07
20	DXC TECHNOLOGY CO	DXC UN	119,126.15	0.07

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 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	BRIGHOUSE FINANCIAL INC	BHF UQ	460,153.85	0.26
2	MATTEL INC	MAT UQ	407,218.04	0.23
3	Encana Corporation	ECA UN	401,785.82	0.23
4	CIGNA CORP	CI UN	378,362.67	0.21
5	DOMINION ENERGY INC	D UN	378,001.99	0.21
6	WALT DISNEY CO/THE	DIS UN	370,242.84	0.21
7	FLUOR CORP	FLR UN	336,432.25	0.19
8	Cboe Global Markets, Inc	CBOE UF	314,014.90	0.18
9	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	GT UQ	293,221.22	0.16
10	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC UN	274,898.27	0.15
11	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	FLT UN	273,160.35	0.15
12	GLOBAL PAYMENTS INC	GPN UN	269,213.73	0.15
13	FASTENAL CO	FAST UQ	256,532.37	0.14
14	COTY INC-CL A	COTY UN	241,246.48	0.14
15	ULTA BEAUTY INC	ULTA UQ	240,135.28	0.13
16	GENERAL MILLS INC	GIS UN	230,940.94	0.13
17	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYS UN	219,260.15	0.12
18	CINTAS CORP	CTAS UQ	216,498.38	0.12
19	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	TSS UN	215,600.11	0.12

20	MSCI INC	MSCI UN	215,206.75	0.12
----	----------	---------	------------	------

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

### 7.5.3 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	13,854,657.93
卖出收入(成交)总额	45,022,179.06

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

### 7.10 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

无。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

#### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.11.3 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	195,027.59
4	应收利息	913.60
5	应收申购款	564,191.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	113,915.51
8	其他	-
9	合计	874,048.28

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
28,976	3,279.23	266,241.97	0.28	94,752,631.20	99.72

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 8.2 期末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	19,742.21	0.0208

## 8.3 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情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	109,198,256.09
本报告期基金总申购份额	38,525,382.18
减：本报告期基金总赎回份额	52,704,765.10
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	95,018,873.17

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过，自2019年7月6日起，公司总经理由罗登攀变更为谭晓冈。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。



### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	1	58,876,836.99	100.00%	17,662.44	100.00%	-

注：1、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。

2、本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-28
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-06-22
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	2019-05-23
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储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	2019-05-21
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书及摘要（2019 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-05-08
6	大成基金管理有限公司关于通过大成钱柜交易实施费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-25
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-04-19
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基	中国证监会指定报刊及	2019-04-17

	金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	本公司网站	
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业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	2019-04-04
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-29
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晋城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	2019-03-28
12	关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-03-19
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险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	2019-03-05
14	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	2019-02-14
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-19
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰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	2019-01-19
17	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	2019-01-17
18	大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2018 年度第 1 次分红的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-07
19	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2019-01-03

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据我司发布的《大成基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第三十三次会议审议通过，自 2019 年 7 月 6 日起，公司总经理由罗登攀变

更为谭晓冈。具体详见公司相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成标普 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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日