

中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	57

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 沪市 ETF
场内简称	500 沪市 ETF
基金主代码	510440
交易代码	510440
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012 年 8 月 24 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,058,261.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 10 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 沪市指数（代码：000802）
风险收益特征	本基金为股票基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 – 2017年6月30日)
本期已实现收益	-4,934,242.13
本期利润	-3,298,368.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1338
本期加权平均净值利润率	-7.34%
本期基金份额净值增长率	-2.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	11,166,962.88
期末可供分配基金份额利润	0.5062
期末基金资产净值	39,440,810.43
期末基金份额净值	1.788
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	78.80%

- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

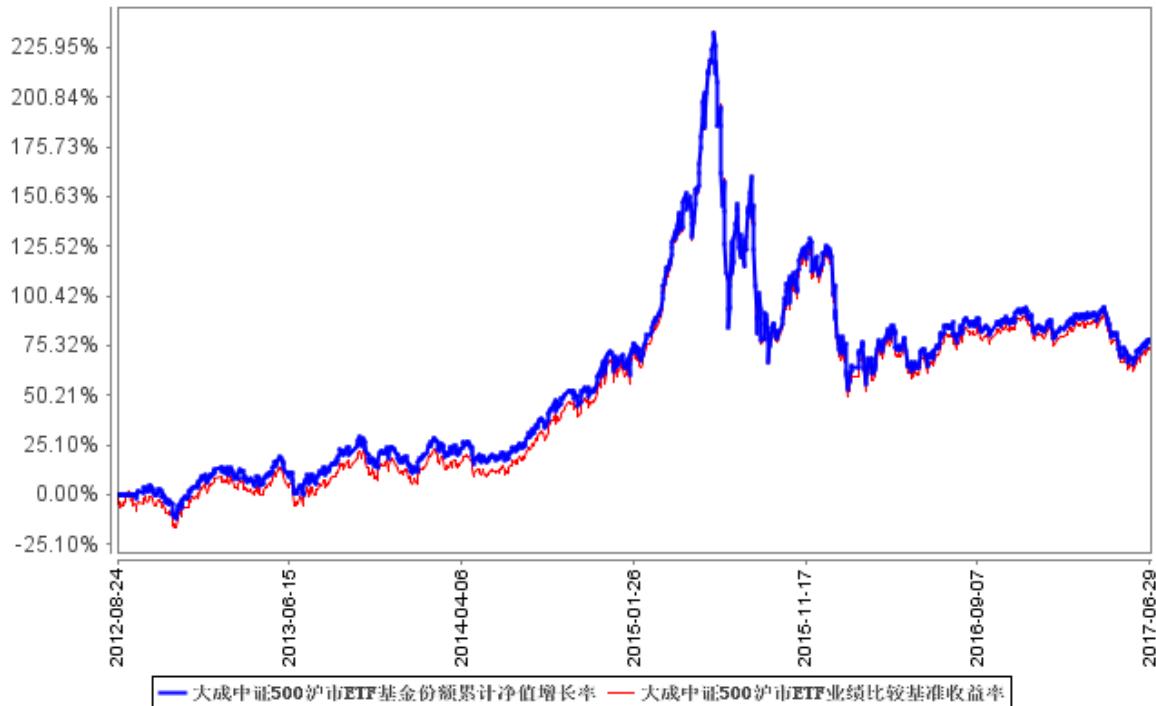
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.80%	0.90%	5.61%	0.91%	0.19%	-0.01%
过去三个月	-5.05%	1.03%	-5.41%	1.03%	0.36%	0.00%
过去六个月	-2.19%	0.87%	-2.61%	0.88%	0.42%	-0.01%
过去一年	2.23%	0.90%	2.31%	0.90%	-0.08%	0.00%
过去三年	47.65%	2.09%	52.61%	2.11%	-4.96%	-0.02%

自基金合同生效起至今	78.80%	1.83%	74.62%	1.87%	4.18%	-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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§ 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、特定客户资产管理及QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2017年6月30日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金，4只QDII基金及74只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2012年8月24日	-	13年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及

					大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	8 年	经济学硕士，中国注册会计师。2008 年 1 月至 2008 年 12 月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师、数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月 20 日至 2017 年 7 月 3 日，担任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、杨台山先生已于 2017 年 7 月 3 日离任本基金基金助理职务。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

- 2、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。
- 3、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的情形；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，在投资的拉动下，宏观经济保持相对稳健的状态。供给侧改革相配合，大宗商品价格保持稳定，CPI、PPI 有所回暖。金融去杠杆政策初见成效，M2 增速开始放缓。海外方面，整体环境也趋于良好。马克龙当选法国总统，减轻了市场对于欧元区瓦解的担忧；而川普新政不达预期，令美元持续走弱，也在一定程度上缓解了人民币贬值的压力。

相对于宏观经济基本面，监管政策对流动性以及资本市场的影响更为直接。为了应对春节现金需求的流动性的冲击，央行创设了临时流动性便利工具，春节前流动性冲击低于市场预期，但之后 MLF 利率、公开市场操作、SLF 利率相继上调，形成结构性加息，表明货币政策依然中性偏紧，央行既希望避免流动性遭受冲击，也希望继续推动金融市场去杠杆。春节后，虽然 TLF 并未续作，其它节前央行投放的流动性也在逐步回收，但对市场流动性冲击不大，市场随之反弹。雄安新区消息出台后，股票市场到达短期高点，之后监管政策陆续出台，着力在金融领域去杠杆，引发了权益市场和固定收益市场在四、五月份的调整。进入六月份，为了避免出现系统性风险，监管政策有所缓和，央行也及时释放流动性，市场随之企稳走强。上半年市场基准沪深 300 指数上涨 10.78%。市场风格分化非常大，ROE 因子表现优异，家电、金融、消费等价值型板块领涨大市。

本基金标的指数中证 500 沪市指数下跌 2.48%，跌幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。上半年各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.788 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.19%，业绩比较基准收益率为-2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

对于股票市场，监管政策是目前最重要的影响因素。虽然金融市场去杠杆的基调没有争议，

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间

同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外) 的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对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：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	213, 260. 51	314, 298. 90
结算备付金		29, 827. 49	4, 151. 86
存出保证金		533. 92	294. 62
交易性金融资产	6.4.3.2	39, 301, 927. 06	40, 148, 572. 59
其中：股票投资		39, 301, 927. 06	40, 148, 572. 59
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.3.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.3.4	—	—
应收证券清算款		60, 991. 65	—
应收利息	6.4.3.5	50. 25	65. 58
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.3.6	—	—
资产总计		39, 606, 590. 88	40, 467, 383. 55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	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		—	—
应付管理人报酬		15, 712. 63	17, 996. 18
应付托管费		3, 142. 53	3, 599. 26
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.3.7	12, 622. 73	7, 572. 84

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	134,302.56	120,000.00
负债合计		165,780.45	149,168.28
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	22,058,261.00	22,058,261.00
未分配利润	6.4.3.10	17,382,549.43	18,259,954.27
所有者权益合计		39,440,810.43	40,318,215.27
负债和所有者权益总计		39,606,590.88	40,467,383.55

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.788 元，基金份额总额 22,058,061.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-2,959,816.14	-10,398,201.15
1.利息收入		2,084.87	2,810.18
其中：存款利息收入	6.4.3.11	2,083.71	2,810.18
债券利息收入		1.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,591,672.20	-2,519,973.85
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-4,848,919.55	-2,760,781.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	830.44	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	256,416.91	240,807.41
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.3.17	1,635,873.35	-7,881,880.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.3.18	-6,102.16	843.00

减：二、费用		338,552.64	332,017.17
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	110,922.66	105,121.70
2. 托管费	6.4.6.2.2	22,184.54	21,024.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	21,002.88	18,458.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	184,442.56	187,412.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,298,368.78	-10,730,218.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,298,368.78	-10,730,218.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,058,261.00	18,259,954.27	40,318,215.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,298,368.78	-3,298,368.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	2,420,963.94	2,420,963.94
其中：1. 基金申购款	14,000,000.00	12,269,286.90	26,269,286.90
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-9,848,322.96	-23,848,322.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	22,058,261.00	17,382,549.43	39,440,810.43

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基 金净值）	24,058,261.00	29,055,002.00	53,113,263.00
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润）	-	-10,730,218.32	-10,730,218.32
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)	-1,000,000.00	-1,046,073.62	-2,046,073.62
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	1,862,675.50	4,862,675.50
2. 基金赎回款	-4,000,000.00	-2,908,749.12	-6,908,749.12
四、本期向基金份额持有 人分配利润产生的基金 净值变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基 金净值）	23,058,261.00	17,278,710.06	40,336,971.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

周立新

崔伟

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致的说明

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一致。

6.4.2 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

6.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债

券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	213,260.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	213,260.51

注：本基金于本会计期间未投资于定期存款或其他存款。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,271,942.73	39,301,927.06	-3,970,015.67
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	43,271,942.73	39,301,927.06	-3,970,015.67

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	38.01
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	12.06
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.18
合计	50.25

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,622.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,622.73

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	84,302.56
预提审计费	-
信息披露费	-
可退替代款	-
合计	134,302.56

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,058,261.00	22,058,261.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-14,000,000.00	-14,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	22,058,261.00	22,058,261.00

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	16,023,482.35	2,236,471.92	18,259,954.27
本期利润	-4,934,242.13	1,635,873.35	-3,298,368.78
本期基金份额交易产生的变动数	77,722.66	2,343,241.28	2,420,963.94
其中：基金申购款	10,194,615.24	2,074,671.66	12,269,286.90
基金赎回款	-10,116,892.58	268,569.62	-9,848,322.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,166,962.88	6,215,586.55	17,382,549.43

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
活期存款利息收入		1,963.38
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		116.16
其他		4.17
合计		2,083.71

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-770,218.43
股票投资收益——赎回差价收入	-4,078,701.12
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-4,848,919.55

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	6,351,298.46
减： 卖出股票成本总额	7,121,516.89
买卖股票差价收入	-770,218.43

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	23,848,322.96
减： 现金支付赎回款总额	830,320.96
减： 赎回股票成本总额	27,096,703.12
赎回差价收入	-4,078,701.12

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	830.44

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	830.44

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,831.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,000.00
减：应收利息总额	1.16
买卖债券差价收入	830.44

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	256,416.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	256,416.91

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,635,873.35
——股票投资	1,635,873.35
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	1,635,873.35

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-6,102.16
—	—
合计	-6,102.16

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

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	21,002.88
银行间市场交易费用	—
合计	21,002.88

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

审计费用	9,916.99
信息披露费	74,385.57
银行费用	140.00
指数使用费	100,000.00
债券托管帐户维护费	-
其他	-
合计	184,442.56

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000.00 元。

6.4.3.21 分部报告

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

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新”）	基金管理人的合营企业

资本”)	
------	--

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	9,773,933.71	66.71%	-	0.00%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
光大证券	8,907.63	66.72%	8,907.63	70.57%
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日				
关联方名称	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
-	-	0.00	-	0.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	110,922.66	105,121.70
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,184.54	21,024.35

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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

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

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 8 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	17,000,000.00	17,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	77.0700%	73.7300%

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	213,260.51	1,963.38	737,171.28	2,657.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600643	爱建集团	2017年4月18日	临时停牌	14.98	2017年8月2日	16.48	33,705	479,882.68	504,900.90	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	临时停牌	7.29	-	-	39,994	350,933.94	291,556.26	-
600655	豫园商城	2017年5月17日	临时停牌	11.32	-	-	23,000	356,516.79	260,360.00	-
600277	亿利洁能	2017年3月6日	临时停牌	7.83	-	-	18,200	117,119.05	142,506.00	-
600545	新疆城建	2017年6月22日	临时停牌	11.96	2017年7月3日	12.44	11,866	141,602.04	141,917.36	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	临时停牌	7.79	-	-	17,400	146,162.41	135,546.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	临时停牌	10.94	2017年8月18日	12.03	10,459	158,774.47	114,421.46	-
600460	士兰微	2017年5月12日	临时停牌	6.07	2017年8月15日	6.68	17,500	121,751.32	106,225.00	-
601001	大同煤业	2017年6月22日	临时停牌	5.25	2017年7月21日	5.78	18,300	117,359.67	96,075.00	-
600657	信达	2017	临	5.76	2017	6.19	16,600	110,726.14	95,616.00	-

	地产	年 2 月 20 日	时 停 牌		年 8 月 10 日					
600468	百利 电气	2017 年 5 月 16 日	临 时 停 牌	6. 50	-	-	7, 590	73, 705. 92	49, 335. 00	-

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

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。本基金以拟合、跟踪中证 500 沪市指数为原则，通过被动式指数化投资方法，力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可

能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的证券在证券交易所上市。于本期末，除期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折

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

利率风险是指基金的财务状况和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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	213, 260. 51	-	-	-	213, 260. 51
结算备付金	29, 827. 49	-	-	-	29, 827. 49
存出保证金	533. 92	-	-	-	533. 92
交易性金融资产	-	-	-	39, 301, 927. 06	39, 301, 927. 06
应收证券清算款	-	-	-	60, 991. 65	60, 991. 65
应收利息	-	-	-	50. 25	50. 25
资产总计	243, 621. 92	-	-	39, 362, 968. 96	39, 606, 590. 88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15, 712. 63	15, 712. 63
应付托管费	-	-	-	3, 142. 53	3, 142. 53
应付交易费用	-	-	-	12, 622. 73	12, 622. 73
其他负债	-	-	-	134, 302. 56	134, 302. 56
负债总计	-	-	-	165, 780. 45	165, 780. 45
利率敏感度缺口	243, 621. 92	-	-	39, 197, 188. 51	39, 440, 810. 43

上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	314, 298. 90	-	-	-	314, 298. 90
结算备付金	4, 151. 86	-	-	-	4, 151. 86
存出保证金	294. 62	-	-	-	294. 62
交易性金融资产	-	-	-40, 148, 572. 59	40, 148, 572. 59	
应收利息	-	-	-	65. 58	65. 58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	318, 745. 38	-	-40, 148, 638. 17	40, 467, 383. 55	
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17, 996. 18	17, 996. 18
应付托管费	-	-	-	3, 599. 26	3, 599. 26
应付交易费用	-	-	-	7, 572. 84	7, 572. 84
其他负债	-	-	-	120, 000. 00	120, 000. 00
负债总计	-	-	-	149, 168. 28	149, 168. 28
利率敏感度缺口	318, 745. 38	-	-39, 999, 469. 89	40, 318, 215. 27	

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指类型证券投资基金，于本报告期末，未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且基金管理人每日对本基金所持有的

证券价格实施监控。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	39,301,927.06	99.65	40,148,572.59	99.58
交易性金融资产—基金投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—债券投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	0.00	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	0.00	—	0.00
其他	—	0.00	—	0.00
合计	39,301,927.06	99.65	40,148,572.59	99.58

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	中证 500 沪市指数上升 5%	1,960,000.00	1,991,858.91
	中证 500 沪市指数下降 5%	-1,960,000.00	-1,991,858.91

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	39,301,927.06	99.23
	其中：股票	39,301,927.06	99.23
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	243,088.00	0.61
7	其他各项资产	61,575.82	0.16
8	合计	39,606,590.88	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	146,540.00	0.37
B	采矿业	1,430,070.28	3.63
C	制造业	23,733,634.10	60.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,429,160.14	3.62
E	建筑业	667,558.09	1.69
F	批发和零售业	2,630,774.93	6.67
G	交通运输、仓储和邮政业	2,015,657.87	5.11
H	住宿和餐饮业	97,560.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,437,380.91	3.64
J	金融业	790,900.90	2.01
K	房地产业	2,855,396.42	7.24

L	租赁和商务服务业	509,362.35	1.29
M	科学研究和技术服务业	216,712.60	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	156,662.48	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	97,734.00	0.25
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	697,526.24	1.77
S	综合	389,295.75	0.99
	合计	39,301,927.06	99.65

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600487	亨通光电	18,976	532,276.80	1.35
2	600643	爱建集团	33,705	504,900.90	1.28
3	600201	生物股份	13,400	476,638.00	1.21
4	601012	隆基股份	26,100	446,310.00	1.13
5	600219	南山铝业	121,150	410,698.50	1.04
6	603799	华友钴业	6,500	395,070.00	1.00
7	600525	长园集团	28,798	391,364.82	0.99
8	600079	人福医药	19,700	386,514.00	0.98
9	600176	中国巨石	34,765	381,719.70	0.97
10	600315	上海家化	11,760	381,612.00	0.97
11	600642	申能股份	59,600	375,480.00	0.95
12	603444	吉比特	1,300	368,329.00	0.93
13	600584	长电科技	20,952	336,279.60	0.85

14	600516	方大炭素	22,600	321,372.00	0.81
15	601168	西部矿业	41,600	319,904.00	0.81
16	600879	航天电子	35,742	314,172.18	0.80
17	600056	中国医药	11,708	303,822.60	0.77
18	600266	北京城建	20,600	299,524.00	0.76
19	600839	四川长虹	80,600	291,772.00	0.74
20	600673	东阳光科	39,994	291,556.26	0.74
21	600426	华鲁恒升	24,773	290,835.02	0.74
22	600388	龙净环保	18,700	290,411.00	0.74
23	600166	福田汽车	102,000	289,680.00	0.73
24	600521	华海药业	13,737	289,026.48	0.73
25	600291	西水股份	13,000	286,000.00	0.73
26	600161	天坛生物	7,315	283,895.15	0.72
27	600325	华发股份	33,650	280,977.50	0.71
28	600528	中铁工业	19,400	277,226.00	0.70
29	600022	山东钢铁	130,330	268,479.80	0.68
30	600138	中青旅	12,689	267,230.34	0.68
31	600699	均胜电子	8,300	266,347.00	0.68
32	600978	宜华生活	25,927	260,566.35	0.66
33	600655	豫园商城	23,000	260,360.00	0.66
34	601000	唐山港	49,770	259,799.40	0.66
35	603589	口子窖	6,600	256,014.00	0.65
36	600614	鹏起科技	23,170	254,870.00	0.65
37	600435	北方导航	17,800	254,718.00	0.65
38	600158	中体产业	14,801	253,097.10	0.64
39	600511	国药股份	6,744	244,402.56	0.62
40	600600	青岛啤酒	6,900	242,190.00	0.61
41	600503	华丽家族	35,000	241,850.00	0.61
42	600260	凯乐科技	9,349	236,903.66	0.60
43	600298	安琪酵母	9,030	233,606.10	0.59
44	600755	厦门国贸	25,503	232,587.36	0.59
45	600808	马钢股份	65,100	230,454.00	0.58
46	600635	大众公用	42,279	230,420.55	0.58
47	600717	天津港	18,300	228,567.00	0.58
48	601231	环旭电子	14,300	224,653.00	0.57
49	600122	宏图高科	20,200	224,220.00	0.57
50	600872	中炬高新	12,195	223,168.50	0.57
51	600160	巨化股份	18,500	222,555.00	0.56
52	600633	浙数文化	11,400	220,248.00	0.56

53	600062	华润双鹤	8,000	219,440.00	0.56
54	600418	江淮汽车	20,700	218,385.00	0.55
55	600500	中化国际	22,800	217,968.00	0.55
56	603019	中科曙光	7,700	216,678.00	0.55
57	600143	金发科技	35,600	214,668.00	0.54
58	600392	盛和资源	16,110	212,490.90	0.54
59	600594	益佰制药	13,900	212,114.00	0.54
60	600409	三友化工	20,575	207,190.25	0.53
61	600240	华业资本	22,680	205,480.80	0.52
62	600566	济川药业	5,400	205,362.00	0.52
63	601699	潞安环能	26,200	204,884.00	0.52
64	600312	平高电气	14,831	203,777.94	0.52
65	600811	东方集团	31,200	203,424.00	0.52
66	600884	杉杉股份	12,270	202,086.90	0.51
67	600967	内蒙一机	14,800	201,724.00	0.51
68	600970	中材国际	23,050	200,304.50	0.51
69	601880	大连港	67,530	199,888.80	0.51
70	600026	中远海能	29,857	197,951.91	0.50
71	600809	山西汾酒	5,700	197,733.00	0.50
72	600499	科达洁能	24,700	196,118.00	0.50
73	600183	生益科技	15,845	195,527.30	0.50
74	600307	酒钢宏兴	68,400	194,940.00	0.49
75	600664	哈药股份	33,300	193,473.00	0.49
76	600094	大名城	24,900	190,983.00	0.48
77	600863	内蒙华电	63,400	190,834.00	0.48
78	600787	中储股份	24,016	189,966.56	0.48
79	600572	康恩贝	27,410	189,677.20	0.48
80	600874	创业环保	9,587	187,617.59	0.48
81	600478	科力远	21,325	183,608.25	0.47
82	600881	亚泰集团	35,700	181,356.00	0.46
83	600017	日照港	40,238	181,071.00	0.46
84	600120	浙江东方	6,700	180,096.00	0.46
85	600125	铁龙物流	20,000	179,200.00	0.45
86	600064	南京高科	11,846	178,874.60	0.45
87	600348	阳泉煤业	26,300	178,314.00	0.45
88	600565	迪马股份	31,800	175,218.00	0.44
89	600198	大唐电信	13,525	172,714.25	0.44
90	600597	光明乳业	13,500	172,125.00	0.44
91	600410	华胜天成	19,370	171,618.20	0.44

92	600416	湘电股份	12,390	169,743.00	0.43
93	603766	隆鑫通用	23,100	168,168.00	0.43
94	600687	刚泰控股	13,000	167,440.00	0.42
95	600582	天地科技	36,200	166,158.00	0.42
96	601929	吉视传媒	47,600	164,696.00	0.42
97	600039	四川路桥	39,536	164,469.76	0.42
98	601928	凤凰传媒	16,700	162,992.00	0.41
99	603077	和邦生物	31,884	162,289.56	0.41
100	600466	蓝光发展	18,700	161,381.00	0.41
101	601689	拓普集团	4,800	160,752.00	0.41
102	600282	南钢股份	43,300	160,643.00	0.41
103	600751	天海投资	28,100	159,889.00	0.41
104	600086	东方金钰	14,778	159,750.18	0.41
105	603000	人民网	12,100	159,357.00	0.40
106	600380	健康元	17,369	157,710.52	0.40
107	600557	康缘药业	9,443	156,848.23	0.40
108	600151	航天机电	18,801	154,732.23	0.39
109	600366	宁波韵升	8,619	152,039.16	0.39
110	600694	大商股份	3,900	151,983.00	0.39
111	600200	江苏吴中	11,500	151,800.00	0.38
112	600270	外运发展	8,004	151,515.72	0.38
113	600169	太原重工	39,200	151,312.00	0.38
114	600316	洪都航空	9,400	151,058.00	0.38
115	600611	大众交通	27,350	150,972.00	0.38
116	600835	上海机电	7,094	149,967.16	0.38
117	600759	洲际油气	24,738	149,912.28	0.38
118	600563	法拉电子	3,003	148,378.23	0.38
119	600267	海正药业	12,700	148,336.00	0.38
120	600108	亚盛集团	34,000	146,540.00	0.37
121	600645	中源协和	6,820	146,152.60	0.37
122	600187	国中水务	28,900	145,945.00	0.37
123	600729	重庆百货	5,386	144,560.24	0.37
124	600848	上海临港	6,700	144,452.00	0.37
125	600993	马应龙	6,610	143,965.80	0.37
126	600277	亿利洁能	18,200	142,506.00	0.36
127	600545	新疆城建	11,866	141,917.36	0.36
128	600765	中航重机	10,290	141,796.20	0.36
129	600098	广州发展	17,900	141,589.00	0.36
130	600750	江中药业	3,998	138,930.50	0.35

131	600648	外高桥	7,500	138,900.00	0.35
132	600422	昆药集团	12,100	137,214.00	0.35
133	600073	上海梅林	14,360	137,138.00	0.35
134	600300	维维股份	25,600	136,704.00	0.35
135	601717	郑煤机	17,400	135,546.00	0.34
136	600639	浦东金桥	7,475	135,447.00	0.34
137	603188	亚邦股份	7,600	132,544.00	0.34
138	601311	骆驼股份	9,293	131,588.88	0.33
139	601678	滨化股份	18,838	130,924.10	0.33
140	600284	浦东建设	12,129	130,022.88	0.33
141	600651	飞乐音响	15,215	128,871.05	0.33
142	600259	广晟有色	3,300	128,832.00	0.33
143	600770	综艺股份	17,069	128,017.50	0.32
144	600587	新华医疗	7,184	127,731.52	0.32
145	600496	精工钢构	26,423	127,623.09	0.32
146	600216	浙江医药	12,700	125,857.00	0.32
147	600536	中国软件	6,500	124,540.00	0.32
148	601016	节能风电	33,000	121,440.00	0.31
149	600171	上海贝岭	11,803	120,036.51	0.30
150	600428	中远海特	18,784	116,836.48	0.30
151	603883	老百姓	2,400	116,760.00	0.30
152	600058	五矿发展	9,400	116,654.00	0.30
153	600289	亿阳信通	10,459	114,421.46	0.29
154	600329	中新药业	6,301	114,111.11	0.29
155	603888	新华网	3,500	113,365.00	0.29
156	601233	桐昆股份	8,100	112,266.00	0.28
157	600517	置信电气	14,821	112,194.97	0.28
158	603816	顾家家居	1,900	111,682.00	0.28
159	600894	广日股份	9,400	111,296.00	0.28
160	600736	苏州高新	15,714	111,097.98	0.28
161	601777	力帆股份	13,752	110,566.08	0.28
162	600458	时代新材	9,637	110,343.65	0.28
163	600338	西藏珠峰	2,900	110,171.00	0.28
164	600859	王府井	6,810	109,981.50	0.28
165	603556	海兴电力	2,500	109,725.00	0.28
166	603369	今世缘	8,300	109,560.00	0.28
167	600805	悦达投资	14,895	109,478.25	0.28
168	600586	金晶科技	22,355	109,315.95	0.28
169	600790	轻纺城	16,021	109,103.01	0.28

170	600880	博瑞传播	16,700	109,051.00	0.28
171	600220	江苏阳光	31,157	106,868.51	0.27
172	600395	盘江股份	14,500	106,285.00	0.27
173	600720	祁连山	13,570	106,253.10	0.27
174	600460	士兰微	17,500	106,225.00	0.27
175	600773	西藏城投	9,578	106,028.46	0.27
176	603355	莱克电气	1,800	105,786.00	0.27
177	601886	江河集团	10,100	103,525.00	0.26
178	600006	东风汽车	17,528	102,538.80	0.26
179	600053	九鼎投资	2,900	101,384.00	0.26
180	600801	华新水泥	10,628	101,284.84	0.26
181	603198	迎驾贡酒	5,300	100,859.00	0.26
182	600596	新安股份	11,857	100,191.65	0.25
183	600280	中央商场	12,600	99,918.00	0.25
184	600757	长江传媒	13,271	99,134.37	0.25
185	600059	古越龙山	10,660	98,605.00	0.25
186	600869	智慧能源	14,608	98,311.84	0.25
187	600628	新世界	8,481	97,955.55	0.25
188	603377	东方时尚	2,600	97,734.00	0.25
189	600141	兴发集团	7,900	97,723.00	0.25
190	600754	锦江股份	3,600	97,560.00	0.25
191	600580	卧龙电气	14,128	96,352.96	0.24
192	601001	大同煤业	18,300	96,075.00	0.24
193	600657	信达地产	16,600	95,616.00	0.24
194	600481	双良节能	17,714	94,061.34	0.24
195	600292	远达环保	8,516	91,802.48	0.23
196	600195	中牧股份	4,702	91,171.78	0.23
197	601002	晋亿实业	10,408	90,029.20	0.23
198	600640	号百控股	5,300	89,570.00	0.23
199	600537	亿晶光电	17,980	89,540.40	0.23
200	600971	恒源煤电	11,000	89,430.00	0.23
201	600862	中航高科	9,200	89,148.00	0.23
202	600748	上实发展	12,103	87,141.60	0.22
203	600743	华远地产	20,579	86,843.38	0.22
204	600826	兰生股份	4,602	83,296.20	0.21
205	600251	冠农股份	10,378	82,712.66	0.21
206	603169	兰石重装	6,800	82,620.00	0.21
207	600996	贵广网络	6,900	82,593.00	0.21
208	600335	国机汽车	6,832	81,710.72	0.21

209	603868	飞科电器	1, 300	80, 392. 00	0. 20
210	600831	广电网络	7, 995	79, 550. 25	0. 20
211	600184	光电股份	4, 073	76, 409. 48	0. 19
212	600776	东方通信	10, 502	71, 203. 56	0. 18
213	603698	航天工程	2, 800	70, 560. 00	0. 18
214	600551	时代出版	4, 453	70, 312. 87	0. 18
215	603005	晶方科技	2, 500	69, 975. 00	0. 18
216	603001	奥康国际	3, 542	66, 554. 18	0. 17
217	603568	伟明环保	3, 000	64, 860. 00	0. 16
218	603567	珍宝岛	3, 800	63, 954. 00	0. 16
219	603228	景旺电子	1, 300	62, 725. 00	0. 16
220	603328	依顿电子	4, 400	62, 260. 00	0. 16
221	603528	多伦科技	4, 100	58, 917. 00	0. 15
222	600936	广西广电	7, 300	58, 911. 00	0. 15
223	603806	福斯特	1, 800	57, 618. 00	0. 15
224	603658	安图生物	1, 300	56, 030. 00	0. 14
225	600126	杭钢股份	7, 800	53, 508. 00	0. 14
226	600618	氯碱化工	5, 000	53, 400. 00	0. 14
227	603515	欧普照明	1, 400	50, 568. 00	0. 13
228	600468	百利电气	7, 590	49, 335. 00	0. 13
229	601020	华钰矿业	2, 100	46, 263. 00	0. 12
230	603866	桃李面包	1, 300	46, 254. 00	0. 12
231	603569	长久物流	1, 300	43, 459. 00	0. 11
232	603877	太平鸟	1, 300	36, 387. 00	0. 09
233	600917	重庆燃气	3, 800	35, 834. 00	0. 09
234	601811	新华文轩	2, 300	35, 788. 00	0. 09
235	603025	大豪科技	1, 300	34, 320. 00	0. 09
236	603286	日盈电子	890	13, 528. 00	0. 03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603444	吉比特	370,610.00	0.92
2	600642	申能股份	369,606.00	0.92
3	603799	华友钴业	283,754.76	0.70
4	600839	四川长虹	281,474.00	0.70
5	601000	唐山港	231,242.00	0.57
6	600566	济川药业	202,614.00	0.50
7	600388	龙净环保	182,023.00	0.45
8	601928	凤凰传媒	163,227.00	0.40
9	603000	人民网	161,434.00	0.40
10	600582	天地科技	155,572.00	0.39
11	600158	中体产业	147,594.00	0.37
12	600848	上海临港	145,360.00	0.36
13	600645	中源协和	144,998.00	0.36
14	600648	外高桥	136,219.82	0.34
15	600143	金发科技	126,447.00	0.31
16	603556	海兴电力	118,797.00	0.29
17	603888	新华网	118,367.00	0.29
18	600291	西水股份	116,668.00	0.29
19	600176	中国巨石	109,436.00	0.27
20	603816	顾家家居	104,573.00	0.26

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600522	中天科技	483,738.80	1.20
2	600682	南京新百	428,796.00	1.06
3	600436	片仔癀	385,583.00	0.96
4	600497	驰宏锌锗	224,782.00	0.56
5	600549	厦门钨业	212,319.00	0.53

6	600601	方正科技	179,715.00	0.45
7	600067	冠城大通	157,800.20	0.39
8	600575	皖江物流	148,112.90	0.37
9	600851	海欣股份	139,856.12	0.35
10	600175	美都能源	129,604.40	0.32
11	600823	世茂股份	124,166.00	0.31
12	601010	文峰股份	121,631.98	0.30
13	601801	皖新传媒	115,569.48	0.29
14	600850	华东电脑	105,934.16	0.26
15	600433	冠豪高新	93,967.00	0.23
16	600351	亚宝药业	92,072.19	0.23
17	600180	瑞茂通	87,902.10	0.22
18	600825	新华传媒	84,905.46	0.21
19	601005	*ST 重钢	82,836.00	0.21
20	600483	福能股份	73,726.00	0.18

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,392,742.33
卖出股票收入（成交）总额	6,351,298.46

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

期末本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	533.92
2	应收证券清算款	60,991.65
3	应收股利	—
4	应收利息	50.25
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	61,575.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600643	爱建集团	504,900.90	1.28	临时停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
298	74,021.01	19,335,450.00	87.66%	2,722,811.00	12.34%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额 比例
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	77.07%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	9.07%
3	广州国资产业发展股权投资基金合 伙企业(有限合伙)	251,632.00	1.14%
4	刘必强	116,799.00	0.53%
5	高翔	94,600.00	0.43%
6	贺顺龙	90,000.00	0.41%
7	中国银河证券股份有限公司	83,318.00	0.38%
8	张春雁	72,900.00	0.33%
9	王焕永	68,400.00	0.31%
10	吴炳芬	67,253.00	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

注：无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

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

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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安永华明会计师事务所(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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。本报告期内，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。

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	
光大证券	2	9,773,933.71	66.71%	8,907.63	66.72%	-
广发证券	1	4,076,560.56	27.83%	3,715.10	27.83%	-
招商证券	2	799,798.45	5.46%	728.86	5.46%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投证 券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内本基金新增席位：无。

本报告期内本基金退租席位：无。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	8,831.60	100.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投证 券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 27 日
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 21 日
4	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 16 日
5	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 14 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日

	值调整的公告		
8	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
10	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 24 日
11	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
12	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
14	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 日
15	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
16	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
18	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
19	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
20	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
21	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
22	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
24	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日

25	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
26	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2017 年 1 期) -摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 7 日
27	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2017 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 7 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
29	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
30	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
31	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
32	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
33	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
34	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
35	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
36	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
37	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
38	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
39	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告(杜鹏)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
40	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
41	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口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 2 月 15 日
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日

43	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
45	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
46	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
47	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
48	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
49	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
50	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	17,000,000.00	-	-	17,000,000.00	77.07%
	2	20170417-20170521	-	14,251,632.00	14,000,000.00	251,632.00	1.14%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大量赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日