

大成深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2018 年半年度报告

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 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 2018 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合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63

§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成深证 ETF
场内简称	深证 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,335,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-14,350,802.98
本期利润	-44,787,431.23
加权平均基金份额本期利润	-1.6355
本期加权平均净值利润率	-14.45%
本期基金份额净值增长率	-14.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-154,457,549.40
期末可供分配基金份额利润	-5.8650
期末基金资产净值	263,907,198.83
期末基金份额净值	10.021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-34.21%

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）。

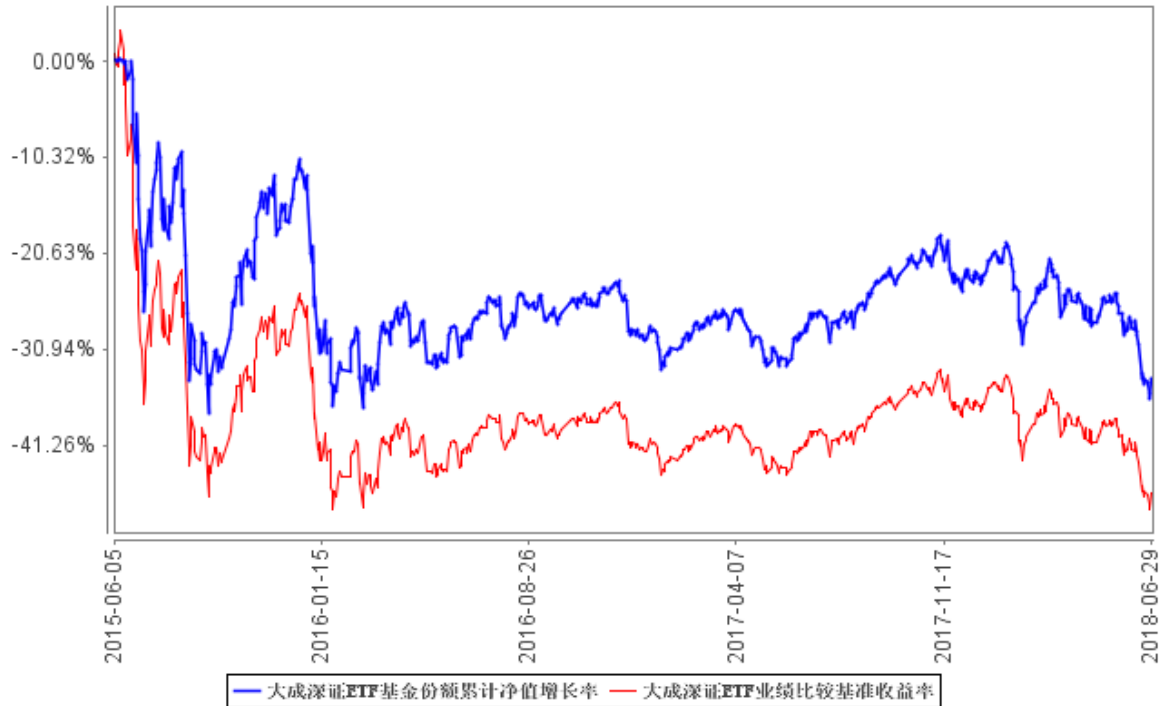
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.43%	1.68%	-8.90%	1.73%	0.47%	-0.05%
过去三个月	-12.88%	1.31%	-13.70%	1.34%	0.82%	-0.03%
过去六个月	-14.46%	1.34%	-15.04%	1.37%	0.58%	-0.03%
过去一年	-9.68%	1.13%	-10.92%	1.15%	1.24%	-0.02%
过去三年	-30.28%	1.74%	-34.58%	1.77%	4.30%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-34.21%	1.76%	-46.41%	1.83%	12.20%	-0.07%

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。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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2018 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 75 只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2015 年 6 月 5 日	-	14 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。2018 年 6 月 26 日起担任大成景恒混合型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
刘淼女士	本基金基金经理助理	2017 年 9 月 14 日	-	10 年	北京大学 MBA。2008 年 4 月至 2011 年 5 月任招商基金管理有限公司基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计、股票投资部风控员兼投委会秘书、数量与指数投资部数量分析师。2017 年 9 月 14 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金和中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具备基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异，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 1 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 2 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

上半年度，整体宏观经济环境出现了较大的变化，两会和中美贸易摩擦是上半年影响最大的外生变量。两会从顶层确立了我国未来发展的基调，而贸易摩擦则是全球政治、经济环境剧变的集中体现。在剧烈冲击下，国内宏观政策也有较大改变。经济下行压力开始出现，出于维稳的需要，去杠杆、金融整肃趋于温和，财政政策也有更加积极的趋势。此外，人民币相对美元发生了较为明显的贬值，对冲了部分贸易摩擦带来的出口压力，同时也带来了资本外流的隐忧。

上半年股票市场也经历了较大幅度的波动。进入新年后，大盘蓝筹股强劲上涨，走出逼空式行情，但行情过度透支，交易极其拥挤，在一系列因素作用下，最终由外围股市下跌引发剧烈调整。之后，市场风格出现逆转，创业板等成长类股票率先企稳，为所谓“独角兽”回归营造了良

好的市场氛围。市场盘整一段时间后，最终仍无法承受去杠杆、贸易摩擦等多重压力，继续下挫直至半年末。本报告期市场基准沪深 300 指数下跌 12.90%，大多数行业、板块均有较大幅度的下跌，消费类板块由于其业绩确定性，在弱市中表现出较为优秀的防御特征，其中休闲服务、医药生物、食品饮料行业更是逆市上涨。市场表现出明显的避险特征，基本面稳定的股票由于其确定性，投资者给予了一定的溢价，这也是上半年大市值股票表现较好的原因之一。

本基金标的指数深成指下跌 15.04%，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。上半年年化跟踪误差 0.94%，日均偏离度 0.03%，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 10.021 元；本报告期基金份额净值增长率为-14.46%，业绩比较基准收益率为-15.04%。

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，外部环境和经济政策均面临较大的不确定性。经济基本面短期内不会发生较大变化，但目前国内经济增长质量明显低于政府预期。中美贸易摩擦并没有缓和的迹象，人民币汇率也不稳定，这无疑加大了政策制定的难度。“既要又要”式的复合目标越来越难实现，政府很难兼顾多方面的均衡。在内外多重压力下，短期稳定压倒长期增长，暂时成为优先级更高的目标，货币政策和财政政策保持宽松是必然选择。当内外环境稳定后，为了经济可持续发展，去杠杆、调结构的大趋势仍然不会变。

对于股票市场，下半年的形势更加错综复杂。经济基本面无疑并不会太好，然而经济下行加上外部压力，有可能会倒逼政策，令去杠杆节奏有所放缓。这对刚经历过大跌的股市来说，基本面恶化已经在一定程度上反映在股价里，综合来看反而造成边际改善的短期利好。在货币政策保持宽松的情况下，市场流动性并不紧缺，只要投资者风险偏好提升，即有可能带来一波反弹。

预计下半年市场总体走势应好于上半年。反弹行情若如期出现，其性质仍属于悲观预期修复所带来的超跌反弹。总体而言，之前成长股超跌程度更甚于价值股，部分质地尚可而被市场错杀沦为小市值的股票有望迎来修复行情。成长板块将先于价值板块反弹，强度也会相对较高。值得注意的是，即使总体环境有所改善，个股风险依然不能忽视，基本面恶化、股权质押、财务报表等因素造成的个股“地雷”也会陆续爆发，基金经理需要以更高的标准筛选股票。

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的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.3.1	8,917,082.34	3,888,932.20
结算备付金		11,443.31	3,635.23
存出保证金		2,046.18	3,108.73
交易性金融资产	6.4.3.2	253,754,312.05	333,415,965.87
其中：股票投资		253,754,312.05	333,087,565.87
基金投资		-	-
债券投资		-	328,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,627,434.55	-
应收利息	6.4.3.5	1,026.04	837.78
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		264,313,344.47	337,312,479.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	190,599.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		114,363.54	143,868.13
应付托管费		22,872.71	28,773.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	8,158.42	4,560.40
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	260,750.97	315,000.00
负债合计		406,145.64	682,801.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	401,180,599.42	437,741,105.78
未分配利润	6.4.3.10	-137,273,400.59	-101,111,427.45
所有者权益合计		263,907,198.83	336,629,678.33
负债和所有者权益总计		264,313,344.47	337,312,479.81

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 10.021 元，基金份额总额 26,335,342.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-43,462,000.85	17,002,527.12
1.利息收入		15,776.25	13,067.39
其中：存款利息收入	6.4.3.11	15,750.47	13,067.39
债券利息收入		25.78	-
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）		-13,041,148.85	-17,165,054.14
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-14,888,329.61	-19,632,102.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	35,893.09	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-	-
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	1,811,287.67	2,467,047.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-30,436,628.25	34,154,513.87
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	-	-
减：二、费用		1,325,430.31	1,646,384.95
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	767,069.11	1,001,257.50

2. 托管费	6.4.6.2.2	153,413.87	200,251.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	93,816.36	133,874.92
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	311,130.97	311,000.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,787,431.16	15,356,142.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,787,431.16	15,356,142.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	437,741,105.78	-101,111,427.45	336,629,678.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,787,431.23	-44,787,431.23
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）	-36,560,506.36	8,625,458.09	-27,935,048.27
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-36,560,506.36	8,625,458.09	-27,935,048.27
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）	401,180,599.42	-137,273,400.59	263,907,198.83
项目	上年度可比期间 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）	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,356,142.17	15,356,142.17
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）	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-86,831,202.53	25,036,073.20	-61,795,129.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	533,712,434.95	-144,998,114.93	388,714,320.02

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</u>
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一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6 号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》及其他相关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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	8,917,082.34
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	8,917,082.34

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	302,584,056.04	253,754,312.05	-48,829,743.99
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	302,584,056.04	253,754,312.05	-48,829,743.99

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,020.64
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	4.59
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	0.81
合计	1,026.04

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,158.42
银行间市场应付交易费用	—
合计	8,158.42

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	210,750.97
合计	260,750.97

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,735,342.00	437,741,105.78
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-2,400,000.00	-36,560,506.36
本期末	26,335,342.00	401,180,599.42

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	-153,557,130.35	52,445,702.90	-101,111,427.45
本期利润	-14,350,802.98	-30,436,628.25	-44,787,431.23
本期基金份额交易产生的变动数	13,450,383.93	-4,824,925.84	8,625,458.09
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	13,450,383.93	-4,824,925.84	8,625,458.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-154,457,549.40	17,184,148.81	-137,273,400.59

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,381.38
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	344.71
其他	24.38
合计	15,750.47

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,419,693.77
股票投资收益——赎回差价收入	-468,635.84
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-14,888,329.61

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	34,033,555.15
减：卖出股票成本总额	48,453,248.92
买卖股票差价收入	-14,419,693.77

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	27,935,048.27
减：现金支付赎回款总额	1,130,331.27
减：赎回股票成本总额	27,273,352.84
赎回差价收入	-468,635.84

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	364,354.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	328,400.00
减：应收利息总额	61.43
买卖债券差价收入	35,893.09

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,811,287.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,811,287.67

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-30,436,628.25
——股票投资	-30,436,628.25
——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	-30,436,628.25

6.4.3.18 其他收入

无。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	93,816.36

银行间市场交易费用	-
合计	93,816.36

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	380.00
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	311,130.97

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。

6.4.4 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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的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

本基金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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
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

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	59,764,771.99	100.00%	10,941,368.78	12.48%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	364,354.52	100.00%	-	0.00%

6.4.6.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.6.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	54,466.00	100.00%	8,158.42	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	9,971.83	12.48%	5,266.82	100.00%
------	----------	--------	----------	---------

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	767,069.11	1,001,257.50
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,413.87	200,251.56

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

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**

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国农业银行	8,917,082.34	15,381.38	5,256,360.92	12,484.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.8 期末（2018 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

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
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大事 项	17.08	-	-	98,510	1,653,063.90	1,682,550.80	-
002739	万达电影	2017 年 7 月	重大事	52.04	-	-	27,200	2,375,029.75	1,415,488.00	-

		4 日	项							
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大事项	19.52	-	-	62,020	1,396,383.86	1,210,630.40	-
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	4.87	-	-	238,426	1,551,144.31	1,161,134.62	-
002075	沙钢股份	2016 年 9 月 19 日	重大事项	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	15.03	-	-	61,100	701,969.17	918,333.00	-
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	18.38	38,367	654,770.74	893,183.76	-
000825	太钢不锈	2018 年 4 月 16 日	重大事项	6.00	-	-	101,800	540,659.25	610,800.00	-
300146	汤臣倍健	2018 年 4 月 4 日	重大事项	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.5	34,700	557,721.95	576,020.00	-
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大事项	12.89	2018 年 7 月 9 日	11.43	43,526	809,175.83	561,050.14	-
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大事项	19.99	2018 年 7 月 2 日	11.96	26,890	581,914.45	537,531.10	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大事项	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.19	82,900	729,756.89	484,136.00	-
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大事项	32.50	-	-	13,739	333,166.91	446,517.50	-
000939	凯迪生态	2017 年 11 月 16 日	重大事项	4.99	2018 年 7 月 2 日	4.74	86,788	545,280.79	433,072.12	-
002408	齐翔腾达	2018 年 6 月 19 日	重大事项	12.28	-	-	34,900	383,866.37	428,572.00	-

002147	新光圆成	2018年1月18日	重大事件	14.76	-	-	26,330	326,872.21	388,630.80	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事件	19.58	2018年8月21日	17.62	19,400	436,154.38	379,852.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事件	9.49	-	-	39,138	373,698.12	371,419.62	-
300090	盛运环保	2018年6月4日	重大事件	8.32	2018年7月2日	7.49	43,100	461,256.11	358,592.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事件	4.96	2018年8月7日	4.46	71,200	623,392.97	353,152.00	-
002610	爱康科技	2018年6月5日	重大事件	2.10	-	-	164,400	502,667.67	345,240.00	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大事件	15.27	-	-	22,056	374,974.44	336,795.12	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事件	11.55	-	-	28,000	538,807.92	323,400.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事件	5.37	-	-	57,645	472,295.87	309,553.65	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事件	3.60	2018年7月3日	3.26	83,300	821,074.44	299,880.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事件	5.80	-	-	50,310	536,217.97	291,798.00	-
002411	必康股份	2018年6月19日	重大事件	28.34	-	-	10,200	271,947.53	289,068.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事件	18.76	2018年7月2日	16.88	13,720	261,815.35	257,387.20	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事件	18.08	-	-	14,000	269,918.71	253,120.00	-
002431	棕榈	2018	重大事件	6.71	-	-	37,550	359,670.55	251,960.50	-

	股份	年 5 月 30 日	项							
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大事 项	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	46,000	315,263.83	249,780.00	-
002716	金贵银业	2018 年 5 月 3 日	重大事 项	16.84	-	-	14,800	339,202.50	249,232.00	-
002668	奥马电器	2018 年 6 月 15 日	重大事 项	20.10	-	-	12,120	265,081.40	243,612.00	-
002089	新海宜	2018 年 4 月 20 日	重大事 项	6.05	2018 年 7 月 20 日	5.45	40,000	450,103.00	242,000.00	-
002477	雏鹰农牧	2018 年 6 月 14 日	重大事 项	3.31	-	-	71,200	430,843.36	235,672.00	-
300118	东方日升	2018 年 5 月 7 日	重大事 项	10.80	2018 年 8 月 7 日	9.63	21,300	349,059.69	230,040.00	-
002437	誉衡药业	2018 年 6 月 11 日	重大事 项	6.20	2018 年 8 月 13 日	5.57	35,200	340,441.64	218,240.00	-
000587	金洲慈航	2018 年 6 月 15 日	重大事 项	4.96	2018 年 7 月 2 日	4.46	38,000	400,212.81	188,480.00	-
002512	达华智能	2018 年 6 月 19 日	重大事 项	9.70	-	-	18,800	340,313.08	182,360.00	-
002143	印纪传媒	2018 年 2 月 2 日	重大事 项	12.09	2018 年 7 月 9 日	10.88	14,660	292,122.09	177,239.40	-
000426	兴业矿业	2018 年 6 月 19 日	重大事 项	7.21	-	-	23,900	212,110.87	172,319.00	-
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大事 项	6.40	-	-	23,100	184,288.86	147,840.00	-
300317	珈伟股份	2018 年 2 月 5 日	重大事 项	11.90	2018 年 7 月 3 日	10.68	12,400	184,695.74	147,560.00	-
000564	供销大集	2017 年 11	重大事	4.78	2018 年 7 月	4.29	24,400	159,163.93	116,632.00	-

		月 28 日	项		20 日					
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 9 日	重大事 项	1.00	-	-	26,800	517,816.87	26,800.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

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

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2017 年 12 月 31 日：0.10%)

6.4.9.3 流动性风险

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

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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注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。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、结算备付金、债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	8,917,082.34	-	-	-	8,917,082.34
结算备付金	11,443.31	-	-	-	11,443.31
存出保证金	2,046.18	-	-	-	2,046.18
交易性金融资产	-	-	-	253,754,312.05	253,754,312.05
应收证券清算款	-	-	-	1,627,434.55	1,627,434.55
应收利息	-	-	-	1,026.04	1,026.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,930,571.83	-	-	255,382,772.64	264,313,344.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	114,363.54	114,363.54
应付托管费	-	-	-	22,872.71	22,872.71

应付交易费用	-	-	-	8,158.42	8,158.42
其他负债	-	-	-	260,750.97	260,750.97
负债总计	-	-	-	406,145.64	406,145.64
利率敏感度缺口	8,930,571.83	-	-	-254,976,627.00	263,907,198.83
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,888,932.20	-	-	-	3,888,932.20
结算备付金	3,635.23	-	-	-	3,635.23
存出保证金	3,108.73	-	-	-	3,108.73
交易性金融资产	-	28,500.00	299,900.00	333,087,565.87	333,415,965.87
应收利息	-	-	-	837.78	837.78
资产总计	3,895,676.16	28,500.00	299,900.00	333,088,403.65	337,312,479.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	190,599.33	190,599.33
应付管理人报酬	-	-	-	143,868.13	143,868.13
应付托管费	-	-	-	28,773.62	28,773.62
应付交易费用	-	-	-	4,560.40	4,560.40
其他负债	-	-	-	315,000.00	315,000.00
负债总计	-	-	-	682,801.48	682,801.48
利率敏感度缺口	3,895,676.16	28,500.00	299,900.00	332,405,602.17	336,629,678.33

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基

金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	253,754,312.05	96.15	333,087,565.87	98.95
交易性金融资产—基金投资	—	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	253,754,312.05	96.15	333,087,565.87	98.95

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	12,910,000.00	16,600,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-12,910,000.00	-16,600,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	253,754,312.05	96.01
	其中：股票	253,754,312.05	96.01
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	8,928,525.65	3.38
7	其他各项资产	1,630,506.77	0.62
8	合计	264,313,344.47	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	5,790,413.28	2.19
B	采矿业	2,201,862.18	0.83
C	制造业	160,751,157.06	60.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,021,336.30	1.14
E	建筑业	4,427,143.37	1.68
F	批发和零售业	6,928,493.95	2.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,755,497.95	0.67
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,187,860.93	9.16
J	金融业	13,859,266.73	5.25
K	房地产业	14,032,349.59	5.32
L	租赁和商务服务业	4,449,586.71	1.69
M	科学研究和技术服务业	276,342.00	0.10

N	水利、环境和公共设施管理业	2,624,872.64	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	3,476,676.68	1.32
R	文化、体育和娱乐业	4,824,584.06	1.83
S	综合	435,023.00	0.16
	合计	253,042,466.43	95.88

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	26,800.00	0.01
C	制造业	561,050.14	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,995.48	0.05
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00

S	综合	-	0.00
	合计	711,845.62	0.27

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	000333	美的集团	193,750	10,117,625.00	3.83
2	000651	格力电器	204,700	9,651,605.00	3.66
3	000858	五粮液	78,900	5,996,400.00	2.27
4	002415	海康威视	141,725	5,262,249.25	1.99
5	000002	万科A	173,300	4,263,180.00	1.62
6	000725	京东方A	1,080,500	3,824,970.00	1.45
7	300498	温氏股份	159,204	3,505,672.08	1.33
8	000001	平安银行	360,000	3,272,400.00	1.24
9	002304	洋河股份	23,962	3,153,399.20	1.19
10	002027	分众传媒	225,288	2,156,006.16	0.82
11	002230	科大讯飞	65,475	2,099,783.25	0.80
12	002024	苏宁易购	147,900	2,082,432.00	0.79
13	000538	云南白药	19,400	2,075,024.00	0.79
14	002008	大族激光	38,000	2,021,220.00	0.77
15	300059	东方财富	152,367	2,008,197.06	0.76
16	000568	泸州老窖	31,000	1,886,660.00	0.71
17	000338	潍柴动力	204,300	1,787,625.00	0.68
18	002475	立讯精密	77,325	1,742,905.50	0.66
19	002594	比亚迪	36,100	1,721,248.00	0.65
20	000776	广发证券	129,400	1,717,138.00	0.65
21	002450	康得新	98,510	1,682,550.80	0.64
22	001979	招商蛇口	83,601	1,592,599.05	0.60
23	002236	大华股份	70,500	1,589,775.00	0.60
24	002466	天齐锂业	31,922	1,583,011.98	0.60
25	002142	宁波银行	96,588	1,573,418.52	0.60
26	300124	汇川技术	45,094	1,479,985.08	0.56
27	300003	乐普医疗	39,026	1,431,473.68	0.54

28	000661	长春高新	6,280	1,429,956.00	0.54
29	002739	万达电影	27,200	1,415,488.00	0.54
30	000963	华东医药	29,079	1,403,061.75	0.53
31	002456	欧菲科技	86,000	1,387,180.00	0.53
32	000063	中兴通讯	104,300	1,359,029.00	0.51
33	002044	美年健康	57,620	1,302,212.00	0.49
34	002460	赣锋锂业	32,550	1,255,779.00	0.48
35	002422	科伦药业	38,800	1,245,480.00	0.47
36	000166	申万宏源	283,860	1,240,468.20	0.47
37	002252	上海莱士	62,020	1,210,630.40	0.46
38	000423	东阿阿胶	22,200	1,194,582.00	0.45
39	002202	金风科技	91,920	1,161,868.80	0.44
40	000540	中天金融	238,426	1,161,134.62	0.44
41	300015	爱尔眼科	35,224	1,137,382.96	0.43
42	000895	双汇发展	41,800	1,103,938.00	0.42
43	000100	TCL 集团	379,000	1,099,100.00	0.42
44	300408	三环集团	46,700	1,097,450.00	0.42
45	300136	信维通信	34,020	1,045,434.60	0.40
46	000413	东旭光电	172,400	1,044,744.00	0.40
47	002075	沙钢股份	64,600	1,041,352.00	0.39
48	000069	华侨城 A	142,000	1,026,660.00	0.39
49	300142	沃森生物	50,800	1,014,984.00	0.38
50	000503	国新健康	31,600	1,004,248.00	0.38
51	000783	长江证券	177,400	963,282.00	0.37
52	300122	智飞生物	20,200	923,948.00	0.35
53	300024	机器人	53,066	923,348.40	0.35
54	002310	东方园林	61,100	918,333.00	0.35
55	300070	碧水源	65,514	912,610.02	0.35
56	300072	三聚环保	38,367	893,183.76	0.34
57	000768	中航飞机	56,700	886,788.00	0.34
58	002241	歌尔股份	84,200	857,998.00	0.33
59	000977	浪潮信息	35,640	850,014.00	0.32
60	000157	中联重科	201,500	828,165.00	0.31
61	000625	长安汽车	91,688	825,192.00	0.31
62	002572	索菲亚	25,508	820,847.44	0.31
63	000425	徐工机械	189,800	804,752.00	0.30
64	000830	鲁西化工	46,000	785,680.00	0.30
65	002410	广联达	28,300	784,759.00	0.30
66	300296	利亚德	60,150	774,732.00	0.29

67	300347	泰格医药	12,500	773,375.00	0.29
68	002007	华兰生物	23,600	758,976.00	0.29
69	002405	四维图新	37,000	749,250.00	0.28
70	002340	格林美	123,320	746,086.00	0.28
71	002049	紫光国微	16,700	736,804.00	0.28
72	000703	恒逸石化	48,820	726,441.60	0.28
73	300144	宋城演艺	30,773	723,165.50	0.27
74	300017	网宿科技	67,452	722,410.92	0.27
75	002736	国信证券	78,000	709,800.00	0.27
76	002001	新 和 成	37,015	701,804.40	0.27
77	002038	双鹭药业	18,167	690,164.33	0.26
78	002050	三花智控	36,300	684,255.00	0.26
79	000786	北新建材	36,800	681,904.00	0.26
80	000623	吉林敖东	37,720	678,205.60	0.26
81	002179	中航光电	17,370	677,430.00	0.26
82	002146	荣盛发展	76,700	669,591.00	0.25
83	002065	东华软件	77,800	669,080.00	0.25
84	002271	东方雨虹	38,902	661,723.02	0.25
85	000418	小天鹅 A	9,500	658,825.00	0.25
86	002714	牧原股份	14,700	653,562.00	0.25
87	300168	万达信息	31,700	646,680.00	0.25
88	000728	国元证券	87,200	645,280.00	0.24
89	000792	盐湖股份	59,287	641,485.34	0.24
90	002508	老板电器	20,890	639,651.80	0.24
91	000860	顺鑫农业	16,900	633,750.00	0.24
92	000998	隆平高科	33,600	633,696.00	0.24
93	002311	海大集团	29,480	622,028.00	0.24
94	002673	西部证券	82,266	621,108.30	0.24
95	002797	第一创业	90,720	614,174.40	0.23
96	300618	寒锐钴业	4,780	613,465.20	0.23
97	000825	太钢不锈	101,800	610,800.00	0.23
98	002129	中环股份	77,700	608,391.00	0.23
99	000630	铜陵有色	273,400	604,214.00	0.23
100	300253	卫宁健康	48,752	604,037.28	0.23
101	002081	金 螳 螂	59,463	600,576.30	0.23
102	002092	中泰化学	62,000	597,680.00	0.23
103	002294	信立泰	15,700	583,569.00	0.22
104	000066	中国长城	82,004	583,048.44	0.22
105	300146	汤臣倍健	34,700	576,020.00	0.22

106	000876	新 希 望	90,000	570,600.00	0.22
107	000513	丽珠集团	12,798	562,472.10	0.21
108	000709	河钢股份	190,200	561,090.00	0.21
109	000566	海南海药	43,526	561,050.14	0.21
110	000656	金科股份	116,600	559,680.00	0.21
111	000050	深天马 A	39,000	554,580.00	0.21
112	000826	启迪桑德	31,629	552,874.92	0.21
113	002465	海格通信	68,400	549,252.00	0.21
114	000839	中信国安	115,300	545,369.00	0.21
115	300383	光环新网	40,500	543,105.00	0.21
116	000581	威孚高科	24,500	541,695.00	0.21
117	002078	太阳纸业	55,700	539,733.00	0.20
118	300266	兴源环境	26,890	537,531.10	0.20
119	002176	江特电机	54,020	525,074.40	0.20
120	002493	荣盛石化	50,850	524,772.00	0.20
121	000690	宝新能源	75,100	522,696.00	0.20
122	002195	二三四五	121,511	520,067.08	0.20
123	000983	西山煤电	68,000	510,680.00	0.19
124	300166	东方国信	34,539	508,759.47	0.19
125	000961	中南建设	79,650	502,591.50	0.19
126	002223	鱼跃医疗	25,730	501,477.70	0.19
127	300088	长信科技	86,200	499,960.00	0.19
128	000488	晨鸣纸业	38,600	498,712.00	0.19
129	002439	启明星辰	23,500	498,670.00	0.19
130	000060	中金岭南	102,400	497,664.00	0.19
131	002589	瑞康医药	36,180	493,495.20	0.19
132	002085	万丰奥威	52,256	491,206.40	0.19
133	300009	安科生物	26,504	488,733.76	0.19
134	000415	渤海金控	82,900	484,136.00	0.18
135	002035	华帝股份	19,800	483,714.00	0.18
136	002019	亿帆医药	27,400	483,610.00	0.18
137	002217	合力泰	58,600	483,450.00	0.18
138	002127	南极电商	51,450	483,115.50	0.18
139	300450	先导智能	15,975	483,084.00	0.18
140	002624	完美世界	15,500	480,655.00	0.18
141	002500	山西证券	70,400	474,496.00	0.18
142	000039	中集集团	35,600	472,768.00	0.18
143	300170	汉得信息	29,100	472,584.00	0.18
144	000596	古井贡酒	5,300	470,534.00	0.18

145	000999	华润三九	16,882	469,826.06	0.18
146	000997	新大陆	29,650	466,987.50	0.18
147	002221	东华能源	47,200	461,144.00	0.17
148	002640	跨境通	30,100	452,102.00	0.17
149	002470	金正大	64,956	446,897.28	0.17
150	002602	世纪华通	13,739	446,517.50	0.17
151	300315	掌趣科技	106,700	446,006.00	0.17
152	300433	蓝思科技	21,240	445,615.20	0.17
153	000732	泰禾集团	22,900	445,405.00	0.17
154	000887	中鼎股份	30,700	442,387.00	0.17
155	002384	东山精密	18,200	436,800.00	0.17
156	000939	凯迪生态	86,788	433,072.12	0.16
157	300027	华谊兄弟	70,231	432,622.96	0.16
158	002013	中航机电	57,062	431,959.34	0.16
159	300182	捷成股份	56,834	430,801.72	0.16
160	002183	怡亚通	64,700	430,255.00	0.16
161	000402	金融街	53,400	429,870.00	0.16
162	002408	齐翔腾达	34,900	428,572.00	0.16
163	000750	国海证券	119,850	427,864.50	0.16
164	000671	阳光城	70,500	420,885.00	0.16
165	002074	国轩高科	29,890	420,253.40	0.16
166	300251	光线传媒	40,880	416,158.40	0.16
167	000988	华工科技	28,700	414,715.00	0.16
168	000960	锡业股份	34,421	413,396.21	0.16
169	002371	北方华创	8,300	412,261.00	0.16
170	002185	华天科技	72,980	411,607.20	0.16
171	002153	石基信息	14,192	411,568.00	0.16
172	000686	东北证券	63,720	408,445.20	0.15
173	000040	东旭蓝天	40,400	408,040.00	0.15
174	300418	昆仑万维	21,600	407,808.00	0.15
175	000009	中国宝安	82,460	404,054.00	0.15
176	000046	泛海控股	71,000	403,990.00	0.15
177	002110	三钢闽光	25,200	403,956.00	0.15
178	000778	新兴铸管	94,200	403,176.00	0.15
179	000930	中粮生化	39,000	401,700.00	0.15
180	000938	紫光股份	6,400	400,640.00	0.15
181	002385	大北农	96,050	396,686.50	0.15
182	000559	万向钱潮	57,728	392,550.40	0.15
183	002558	巨人网络	16,500	392,370.00	0.15

184	300014	亿纬锂能	22,236	391,353.60	0.15
185	002147	新光圆成	26,330	388,630.80	0.15
186	002506	协鑫集成	83,000	388,440.00	0.15
187	300271	华宇软件	21,831	385,972.08	0.15
188	300073	当升科技	11,300	384,878.00	0.15
189	002273	水晶光电	29,765	383,075.55	0.15
190	002359	北讯集团	19,400	379,852.00	0.14
191	002168	深圳惠程	36,900	379,332.00	0.14
192	000547	航天发展	48,300	377,223.00	0.14
193	002138	顺络电子	23,500	376,235.00	0.14
194	002497	雅化集团	35,600	375,224.00	0.14
195	002030	达安基因	24,242	373,811.64	0.14
196	000975	银泰资源	36,841	373,567.74	0.14
197	002268	卫 士 通	17,060	372,419.80	0.14
198	300324	旋极信息	39,138	371,419.62	0.14
199	000401	冀东水泥	41,600	368,992.00	0.14
200	300274	阳光电源	41,080	368,487.60	0.14
201	000807	云铝股份	70,900	367,262.00	0.14
202	000729	燕京啤酒	54,400	366,112.00	0.14
203	300413	快乐购	9,600	364,224.00	0.14
204	000970	中科三环	38,700	361,845.00	0.14
205	002032	苏 泊 尔	7,000	360,500.00	0.14
206	002373	千方科技	27,500	358,875.00	0.14
207	300090	盛运环保	43,100	358,592.00	0.14
208	002028	思源电气	21,100	354,269.00	0.13
209	000008	神州高铁	71,200	353,152.00	0.13
210	000717	韶钢松山	53,800	352,928.00	0.13
211	000878	云南铜业	36,900	352,026.00	0.13
212	300316	晶盛机电	26,480	351,919.20	0.13
213	002352	顺丰控股	7,800	351,000.00	0.13
214	002353	杰瑞股份	21,500	349,375.00	0.13
215	002610	爱康科技	164,400	345,240.00	0.13
216	300203	聚光科技	13,400	343,040.00	0.13
217	002023	海特高新	27,300	342,342.00	0.13
218	002023	海特高新	27,300	342,342.00	0.13
219	000627	天茂集团	48,500	340,470.00	0.13
220	000883	湖北能源	82,700	339,897.00	0.13
221	300010	立思辰	27,761	339,794.64	0.13
222	002407	多氟多	24,200	339,284.00	0.13

223	000898	鞍钢股份	60,655	337,848.35	0.13
224	002051	中工国际	22,056	336,795.12	0.13
225	300058	蓝色光标	58,619	334,128.30	0.13
226	002399	海普瑞	15,080	333,871.20	0.13
227	002366	台海核电	23,400	333,684.00	0.13
228	002396	星网锐捷	16,300	333,661.00	0.13
229	002491	通鼎互联	30,100	333,207.00	0.13
230	002440	闰土股份	28,500	333,165.00	0.13
231	000598	兴蓉环境	81,800	332,108.00	0.13
232	300033	同花顺	8,500	330,395.00	0.13
233	002563	森马服饰	23,000	328,900.00	0.12
234	000516	国际医学	67,700	324,283.00	0.12
235	002573	清新环境	28,000	323,400.00	0.12
236	300287	飞利信	44,900	322,831.00	0.12
237	002244	滨江集团	62,000	322,400.00	0.12
238	300113	顺网科技	18,470	321,562.70	0.12
239	300133	华策影视	30,184	321,459.60	0.12
240	002174	游族网络	16,100	320,390.00	0.12
241	000078	海王生物	66,550	320,105.50	0.12
242	000089	深圳机场	41,800	319,770.00	0.12
243	002583	海能达	38,220	319,137.00	0.12
244	300055	万邦达	27,690	318,158.10	0.12
245	300558	贝达药业	5,700	317,319.00	0.12
246	002383	合众思壮	19,100	316,105.00	0.12
247	300115	长盈精密	24,080	312,317.60	0.12
248	300628	亿联网络	4,700	309,777.00	0.12
249	300197	铁汉生态	57,645	309,553.65	0.12
250	002368	太极股份	10,608	308,374.56	0.12
251	000591	太阳能	84,000	307,440.00	0.12
252	002701	奥瑞金	55,800	304,668.00	0.12
253	002600	领益智造	58,700	304,653.00	0.12
254	002601	龙蟠佰利	23,500	303,855.00	0.12
255	002426	胜利精密	83,300	299,880.00	0.11
256	300036	超图软件	14,700	299,733.00	0.11
257	002004	华邦健康	59,000	299,720.00	0.11
258	002299	圣农发展	19,300	298,957.00	0.11
259	002281	光迅科技	14,100	298,920.00	0.11
260	300355	蒙草生态	49,660	298,456.60	0.11
261	002358	森源电气	19,800	297,990.00	0.11

262	000799	酒鬼酒	10,700	296,925.00	0.11
263	002597	金禾实业	14,600	296,088.00	0.11
264	000981	银亿股份	39,700	295,765.00	0.11
265	000848	承德露露	27,600	292,284.00	0.11
266	002665	首航节能	50,310	291,798.00	0.11
267	300199	翰宇药业	20,300	289,884.00	0.11
268	002517	恺英网络	40,300	289,757.00	0.11
269	000028	国药一致	5,800	289,420.00	0.11
270	002411	必康股份	10,200	289,068.00	0.11
271	000917	电广传媒	50,100	288,576.00	0.11
272	002191	劲嘉股份	38,500	287,595.00	0.11
273	002343	慈文传媒	15,260	286,430.20	0.11
274	002831	裕同科技	5,700	285,000.00	0.11
275	300367	东方网力	22,662	283,275.00	0.11
276	000059	华锦股份	41,000	282,490.00	0.11
277	300463	迈克生物	11,300	281,709.00	0.11
278	002709	天赐材料	7,300	281,342.00	0.11
279	002131	利欧股份	132,834	278,951.40	0.11
280	002152	广电运通	47,150	277,242.00	0.11
281	300159	新研股份	39,000	276,120.00	0.10
282	000738	航发控制	20,600	274,598.00	0.10
283	300496	中科创达	9,300	274,071.00	0.10
284	002745	木林森	15,400	273,966.00	0.10
285	000031	中粮地产	47,300	273,394.00	0.10
286	000800	一汽轿车	36,300	271,524.00	0.10
287	002595	豪迈科技	15,600	271,284.00	0.10
288	002444	巨星科技	24,300	267,543.00	0.10
289	300207	欣旺达	29,600	266,696.00	0.10
290	002285	世联行	42,240	264,844.80	0.10
291	300026	红日药业	72,500	264,625.00	0.10
292	002266	浙富控股	70,540	264,525.00	0.10
293	300098	高新兴	33,092	264,074.16	0.10
294	300244	迪安诊断	13,872	263,706.72	0.10
295	300377	赢时胜	19,350	262,966.50	0.10
296	000902	新洋丰	28,202	259,458.40	0.10
297	002603	以岭药业	18,503	258,671.94	0.10
298	002025	航天电器	11,170	258,027.00	0.10
299	002699	美盛文化	13,720	257,387.20	0.10
300	002151	北斗星通	9,950	255,715.00	0.10

301	002120	韵达股份	4,779	253,525.95	0.10
302	002108	沧州明珠	43,140	253,231.80	0.10
303	000666	经纬纺机	14,000	253,120.00	0.10
304	300212	易华录	10,680	252,582.00	0.10
305	000507	珠海港	26,900	252,322.00	0.10
306	002424	贵州百灵	22,200	252,192.00	0.10
307	002841	视源股份	4,720	252,095.20	0.10
308	002431	棕榈股份	37,550	251,960.50	0.10
309	000012	南玻A	50,554	250,242.30	0.09
310	000723	美锦能源	46,000	249,780.00	0.09
311	000027	深圳能源	50,500	249,470.00	0.09
312	002716	金贵银业	14,800	249,232.00	0.09
313	000758	中色股份	55,300	248,850.00	0.09
314	002505	大康农业	116,030	248,304.20	0.09
315	000006	深振业A	42,327	248,036.22	0.09
316	000766	通化金马	20,800	247,104.00	0.09
317	002128	露天煤业	27,200	246,432.00	0.09
318	000933	神火股份	51,100	245,791.00	0.09
319	002773	康弘药业	4,700	244,447.00	0.09
320	002668	奥马电器	12,120	243,612.00	0.09
321	000926	福星股份	33,800	243,022.00	0.09
322	002089	新海宜	40,000	242,000.00	0.09
323	002056	横店东磁	34,400	241,144.00	0.09
324	000718	苏宁环球	65,509	240,418.03	0.09
325	300053	欧比特	20,600	238,960.00	0.09
326	300101	振芯科技	16,800	237,384.00	0.09
327	000710	贝瑞基因	4,700	236,692.00	0.09
328	300145	中金环境	30,100	235,683.00	0.09
329	002477	雏鹰农牧	71,200	235,672.00	0.09
330	000156	华数传媒	24,300	234,252.00	0.09
331	300294	博雅生物	7,550	233,974.50	0.09
332	002155	湖南黄金	34,200	233,928.00	0.09
333	300068	南都电源	19,500	233,610.00	0.09
334	300222	科大智能	12,600	233,604.00	0.09
335	300257	开山股份	15,200	232,408.00	0.09
336	002672	东江环保	17,650	231,038.50	0.09
337	300459	金科文化	23,900	230,874.00	0.09
338	002250	联化科技	26,100	230,202.00	0.09
339	300118	东方日升	21,300	230,040.00	0.09

340	000021	深科技	33,466	228,238.12	0.09
341	002449	国星光电	21,440	228,121.60	0.09
342	002233	塔牌集团	19,900	227,656.00	0.09
343	002036	联创电子	17,200	225,664.00	0.09
344	002389	南洋科技	16,500	223,410.00	0.08
345	300002	神州泰岳	52,818	220,251.06	0.08
346	000400	许继电气	28,200	220,242.00	0.08
347	002237	恒邦股份	24,100	220,033.00	0.08
348	000685	中山公用	27,600	219,972.00	0.08
349	002180	纳思达	8,000	219,680.00	0.08
350	000036	华联控股	36,900	219,186.00	0.08
351	000563	陕国投 A	64,400	218,960.00	0.08
352	300474	景嘉微	4,700	218,456.00	0.08
353	002048	宁波华翔	17,700	218,241.00	0.08
354	002437	誉衡药业	35,200	218,240.00	0.08
355	002292	奥飞娱乐	24,400	217,892.00	0.08
356	000727	华东科技	115,500	217,140.00	0.08
357	300078	思创医惠	22,720	215,385.60	0.08
358	000712	锦龙股份	21,500	214,570.00	0.08
359	000034	神州数码	13,300	212,534.00	0.08
360	002400	省广集团	65,385	211,193.55	0.08
361	300001	特锐德	18,500	210,160.00	0.08
362	002421	达实智能	50,970	206,428.50	0.08
363	300020	银江股份	21,672	206,100.72	0.08
364	002002	鸿达兴业	44,561	205,426.21	0.08
365	002670	国盛金控	18,993	204,554.61	0.08
366	000869	张裕 A	5,100	203,286.00	0.08
367	002123	梦网集团	22,600	200,914.00	0.08
368	002664	长鹰信质	8,000	200,800.00	0.08
369	002468	申通快递	11,700	200,655.00	0.08
370	300323	华灿光电	15,400	198,968.00	0.08
371	002390	信邦制药	27,100	198,372.00	0.08
372	000088	盐田港	30,100	198,359.00	0.08
373	000937	冀中能源	48,090	197,649.90	0.07
374	002544	杰赛科技	14,423	197,450.87	0.07
375	002501	利源精制	31,700	196,540.00	0.07
376	002242	九阳股份	11,000	194,590.00	0.07
377	002073	软控股份	33,800	194,350.00	0.07
378	000667	美好置业	91,100	194,043.00	0.07

379	002354	天神娱乐	20,920	193,719.20	0.07
380	002047	宝鹰股份	32,800	192,208.00	0.07
381	002635	安洁科技	11,150	191,780.00	0.07
382	300038	梅泰诺	17,900	190,814.00	0.07
383	000979	中弘股份	187,940	189,819.40	0.07
384	000921	海信科龙	18,300	189,588.00	0.07
385	000901	航天科技	18,850	188,877.00	0.07
386	000587	金洲慈航	38,000	188,480.00	0.07
387	300083	劲胜智能	39,100	188,462.00	0.07
388	000592	平潭发展	65,700	186,588.00	0.07
389	300085	银之杰	14,277	185,315.46	0.07
390	002055	得润电子	11,500	183,425.00	0.07
391	000687	华讯方舟	19,900	183,279.00	0.07
392	002512	达华智能	18,800	182,360.00	0.07
393	002555	三七互娱	15,000	182,250.00	0.07
394	002657	中科金财	11,500	182,160.00	0.07
395	000158	常山北明	26,470	181,848.90	0.07
396	000877	天山股份	26,900	181,575.00	0.07
397	002434	万里扬	20,600	180,868.00	0.07
398	002245	澳洋顺昌	27,800	179,866.00	0.07
399	002303	美盈森	33,800	178,464.00	0.07
400	002308	威创股份	21,500	178,450.00	0.07
401	002143	印纪传媒	14,660	177,239.40	0.07
402	002429	兆驰股份	71,300	176,824.00	0.07
403	002503	搜于特	50,500	176,750.00	0.07
404	002043	兔宝宝	23,050	176,563.00	0.07
405	000822	山东海化	25,300	176,341.00	0.07
406	000061	农产品	32,132	173,512.80	0.07
407	000090	天健集团	27,984	173,500.80	0.07
408	000762	西藏矿业	17,958	172,935.54	0.07
409	000426	兴业矿业	23,900	172,319.00	0.07
410	300431	暴风集团	11,321	171,852.78	0.07
411	002608	江苏国信	24,900	171,810.00	0.07
412	002157	正邦科技	41,800	170,126.00	0.06
413	002145	中核钛白	46,200	170,016.00	0.06
414	002643	万润股份	22,500	168,075.00	0.06
415	002428	云南锗业	21,600	166,752.00	0.06
416	300156	神雾环保	24,900	166,083.00	0.06
417	000600	建投能源	29,400	163,758.00	0.06

418	000539	粤电力 A	38,607	163,693.68	0.06
419	002489	浙江永强	44,700	162,708.00	0.06
420	000990	诚志股份	11,500	161,000.00	0.06
421	002642	荣之联	17,500	160,825.00	0.06
422	300075	数字政通	11,700	157,833.00	0.06
423	002249	大洋电机	36,600	157,746.00	0.06
424	002010	传化智联	12,900	156,735.00	0.06
425	000555	神州信息	11,800	156,704.00	0.06
426	300134	大富科技	17,500	156,450.00	0.06
427	000062	深圳华强	7,900	154,840.00	0.06
428	300273	和佳股份	22,500	152,550.00	0.06
429	300364	中文在线	21,412	150,740.48	0.06
430	000612	焦作万方	28,600	150,150.00	0.06
431	000049	德赛电池	5,300	149,566.00	0.06
432	002011	盾安环境	23,100	147,840.00	0.06
433	300317	珈伟股份	12,400	147,560.00	0.06
434	000980	众泰汽车	20,200	143,622.00	0.05
435	002482	广田集团	24,000	143,280.00	0.05
436	002625	光启技术	12,140	142,159.40	0.05
437	002302	西部建设	13,100	141,087.00	0.05
438	002091	江苏国泰	21,800	138,430.00	0.05
439	300310	宜通世纪	21,560	137,552.80	0.05
440	002681	奋达科技	15,600	135,096.00	0.05
441	002190	成飞集成	7,800	133,302.00	0.05
442	000959	首钢股份	32,400	133,164.00	0.05
443	300116	坚瑞沃能	47,000	129,720.00	0.05
444	300458	全志科技	7,223	129,436.16	0.05
445	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
446	002522	浙江众成	19,100	123,577.00	0.05
447	300291	华录百纳	17,400	122,670.00	0.05
448	002261	拓维信息	26,200	120,520.00	0.05
449	000806	银河生物	27,558	119,326.14	0.05
450	000564	供销大集	24,400	116,632.00	0.04
451	002648	卫星石化	9,900	109,197.00	0.04
452	002542	中化岩土	20,400	108,936.00	0.04
453	000615	京汉股份	16,700	105,043.00	0.04
454	000987	越秀金控	12,550	98,643.00	0.04
455	300077	国民技术	6,500	72,280.00	0.03
456	000617	中油资本	5,500	61,820.00	0.02

457	300037	新宙邦	2,200	58,938.00	0.02
458	002022	科华生物	4,600	54,510.00	0.02
459	300137	先河环保	3,400	54,332.00	0.02
460	002277	友阿股份	11,700	53,937.00	0.02
461	002099	海翔药业	10,500	53,865.00	0.02
462	002839	张家港行	8,600	52,374.00	0.02
463	000543	皖能电力	11,750	51,817.50	0.02
464	300079	数码科技	13,700	49,868.00	0.02
465	000620	新华联	8,701	49,334.67	0.02
466	300185	通裕重工	27,200	49,232.00	0.02
467	300352	北信源	11,575	46,763.00	0.02
468	002130	沃尔核材	10,600	46,216.00	0.02
469	000829	天音控股	6,300	46,179.00	0.02
470	300157	恒泰艾普	7,000	45,500.00	0.02
471	000751	锌业股份	12,800	41,728.00	0.02
472	002375	亚厦股份	7,500	40,050.00	0.02
473	000969	安泰科技	6,400	40,000.00	0.02
474	300284	苏交科	5,000	39,650.00	0.02
475	002276	万马股份	6,500	37,960.00	0.01
476	000680	山推股份	10,700	36,808.00	0.01
477	000875	吉电股份	12,400	35,092.00	0.01
478	002106	莱宝高科	6,025	34,704.00	0.01
479	000802	北京文化	3,200	33,408.00	0.01
480	300506	名家汇	1,600	33,168.00	0.01
481	000973	佛塑科技	8,500	32,980.00	0.01
482	002325	洪涛股份	8,700	32,190.00	0.01
483	002326	永太科技	4,600	31,970.00	0.01
484	002307	北新路桥	5,720	31,574.40	0.01
485	000881	中广核技	3,100	30,969.00	0.01
486	002413	雷科防务	5,700	30,723.00	0.01
487	002479	富春环保	5,400	30,510.00	0.01
488	002695	煌上煌	2,200	29,436.00	0.01
489	000957	中通客车	4,300	29,412.00	0.01
490	002342	巨力索具	7,700	29,183.00	0.01
491	000801	四川九洲	6,300	28,161.00	0.01
492	002041	登海种业	4,100	27,962.00	0.01
493	000693	*ST 华泽	26,800	26,800.00	0.01
494	002284	亚太股份	4,600	26,680.00	0.01
495	000018	神州长城	7,900	26,228.00	0.01

496	000558	莱茵体育	7,100	25,418.00	0.01
497	300304	云意电气	5,800	24,360.00	0.01
498	300359	全通教育	3,400	24,208.00	0.01
499	002636	金安国纪	2,900	23,403.00	0.01
500	002175	东方网络	6,000	22,860.00	0.01
501	002018	*ST 华信	10,810	15,674.50	0.01
502	300216	千山药机	2,900	15,399.00	0.01

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

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	000566	海南海药	43,526	561,050.14	0.21
2	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
3	000693	*ST 华泽	26,800	26,800.00	0.01

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	300618	寒锐钴业	1,267,335.00	0.38
2	002027	分众传媒	1,081,520.17	0.32
3	000830	鲁西化工	846,074.44	0.25
4	300628	亿联网络	737,322.00	0.22
5	002594	比亚迪	726,696.00	0.22
6	000401	冀东水泥	683,411.61	0.20
7	002035	华帝股份	677,445.80	0.20
8	000040	东旭蓝天	614,146.61	0.18
9	000591	太阳能	523,442.00	0.16
10	000717	韶钢松山	520,133.00	0.15
11	002497	雅化集团	516,684.00	0.15
12	002359	北讯集团	467,546.00	0.14
13	300316	晶盛机电	462,357.00	0.14
14	000413	东旭光电	452,687.00	0.13
15	002597	金禾实业	422,304.27	0.13

16	002475	立讯精密	409,861.00	0.12
17	000703	恒逸石化	405,290.00	0.12
18	002745	木林森	405,112.00	0.12
19	002841	视源股份	396,535.00	0.12
20	000981	银亿股份	382,806.00	0.11

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	300104	乐视网	586,672.00	0.17
2	000697	炼石有色	537,478.00	0.16
3	002926	华西证券	502,620.96	0.15
4	000651	格力电器	502,610.00	0.15
5	000503	国新健康	479,067.00	0.14
6	300618	寒锐钴业	460,709.00	0.14
7	300750	宁德时代	453,653.00	0.13
8	000725	京东方 A	419,052.00	0.12
9	000002	万 科 A	378,071.00	0.11
10	000858	五 粮 液	342,485.00	0.10
11	002630	华西能源	338,678.00	0.10
12	000518	四环生物	332,905.00	0.10
13	300628	亿联网络	331,205.00	0.10
14	000601	韶能股份	330,910.80	0.10
15	002104	恒宝股份	320,609.00	0.10
16	000001	平安银行	312,576.00	0.09
17	300498	温氏股份	304,316.00	0.09
18	002067	景兴纸业	301,404.09	0.09
19	002251	步 步 高	291,532.00	0.09
20	002916	深南电路	288,554.52	0.09

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	26,829,976.19
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	34,033,555.15
--------------	---------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一平安银行（000001）的发行主体平安银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018）2 号）。本基金认为，对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,046.18
2	应收证券清算款	1,627,434.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,026.04
5	应收申购款	-

6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,630,506.77

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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	000566	海南海药	561,050.14	0.21	临时停牌
2	000693	*ST 华泽	26,800.00	0.01	临时停牌

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

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
7,629	3,452.00	328,592.00	1.25%	26,006,750.00	98.75%

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	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.76%
2	林莹	197,096.00	0.75%
3	贺雅宁	196,965.00	0.75%
4	寇胜利	196,694.00	0.75%
5	吕君	160,000.00	0.61%
6	张小丽	143,146.00	0.54%
7	靳艳华	140,369.00	0.53%
8	谢元禄	131,444.00	0.50%
9	刘小彦	131,310.00	0.50%
10	黎倩嫔	131,306.00	0.50%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 5 日）基金份额总额	2,384,588,069.00
本报告期期初基金份额总额	28,735,342.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	2,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	26,335,342.00

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、托管人及其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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
光大证券	2	59,764,771.99	100.00%	54,466.00	100.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

爱建证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
安信证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
北京高华	1	—	0.00%	—	0.00%	—
长城证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
川财证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
第一创业	1	—	0.00%	—	0.00%	—
东北证券	2	—	0.00%	—	0.00%	—
东方证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
东吴证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
东兴证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—
方正证券	1	—	0.00%	—	0.00%	—

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

2、本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加基金交易单元：无。本报告期内退租基金交易单元：英大证券。

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	364,354.52	100.00%	-	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	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 6 月 22 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏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	2018 年 6 月 16 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财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	2018 年 6 月 9 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府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	2018 年 5 月 17 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海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	2018 年 5 月 4 日
7	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 20 日
8	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 3 日
9	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
10	《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
11	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
12	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
13	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
14	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日

15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 10 日
16	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	2018 年 2 月 3 日
17	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 20 日
18	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 19 日
19	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书-摘要（2017 年 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 19 日
20	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 5 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 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深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

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

2018 年 8 月 29 日