

中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 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：2015 年 8 月 27 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 2015 年 8 月 25 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 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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	5,058,261.00 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	2012-10-08

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	王 永 民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	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	《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	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管与投资者服务部

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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	575,178.80
本期利润	273,995.06
加权平均基金份额本期利润	0.0647
本期加权平均净值利润率	2.86%
本期基金份额净值增长率	55.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,697,468.64
期末可供分配基金份额利润	1.1264
期末基金资产净值	13,050,569.39

期末基金份额净值	2.580
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	158.00%

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。

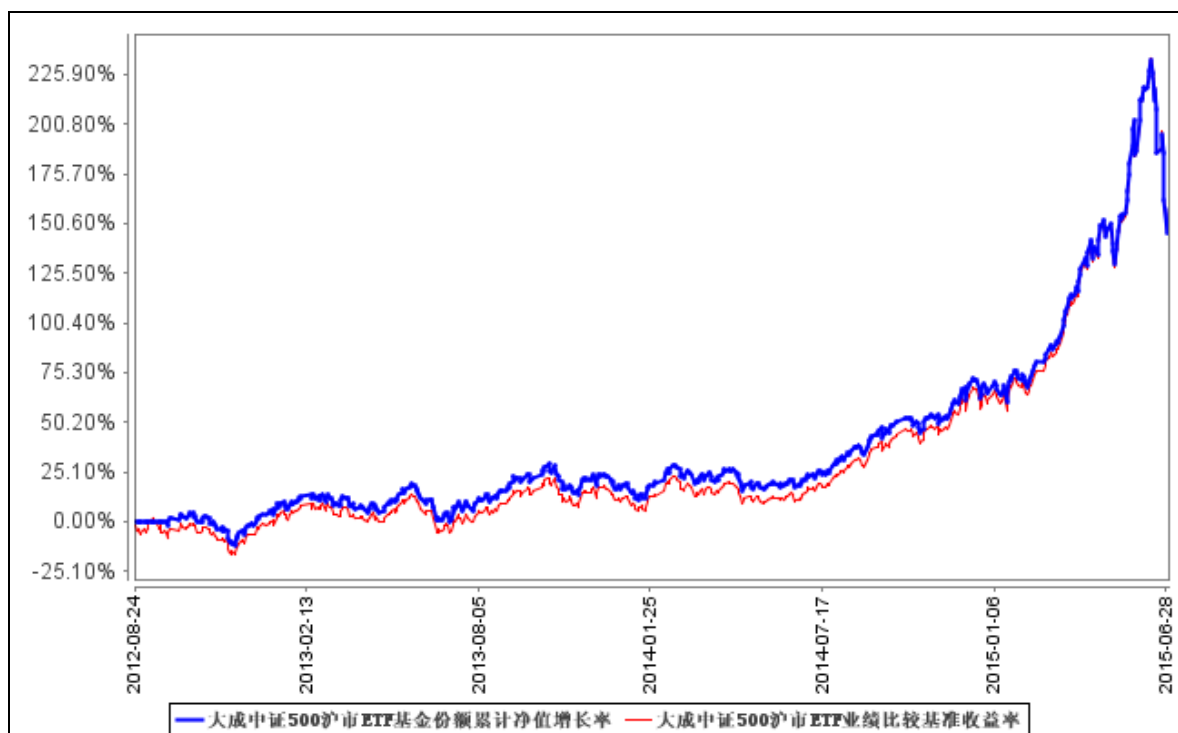
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

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	-10.29%	3.75%	-9.42%	3.87%	-0.87%	-0.12%
过去三个月	19.28%	2.85%	21.21%	2.93%	-1.93%	-0.08%
过去六个月	55.89%	2.27%	60.93%	2.32%	-5.04%	-0.05%
过去一年	113.05%	1.79%	126.95%	1.84%	-13.90%	-0.05%
自基金合同生效起至今	158.00%	1.49%	159.68%	1.58%	-1.68%	-0.09%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至建仓期末，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。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2015 年 6 月 30 日，截至 2015 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：大成中证 100 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、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 51 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、

大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 等。

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	本基金经理	2012 年 8 月 24 日	-	11 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。2011 年 3 月 3 日至 2012 年 2 月 8 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

				<p>型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。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 日开始兼任大成沪深 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。现任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前

提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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，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% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

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

今年上半年，实体经济仍在筑底阶段。虽然以互联网为代表的新经济不乏亮点，但毕竟占体量比例不大，对总体经济增长提振有限。而占主导地位的传统经济积重难返，在底部艰难挣扎。总需求持续萎缩，PPI 和 CPI 下行，通缩风险增大，对地方债务问题更是雪上加霜。尽管政府也果断采取各种措施进行托底，货币政策和财政政策均有所动作，但短期内依然收效甚微。

在资本市场方面，股市和经济基本面持续脱节，更多地是受政策、资金、情绪所主导，上半年也经历了较大的波动。起初，央行行长表态资金进股市也是支持实体经济，大大消除了投资者对政策面打压的担忧，进一步刺激情绪，市场强势上行。但在最后，由去杠杆引发了一波惨烈的下跌。截至上半年，市场基准沪深 300 指数上涨 26.58%。和去年相比，市场风格出现了较大的转换。经历了去年末的暴涨后，大盘股上涨乏力，而小盘股则涨势凌厉。中小板、创业板分别上涨

69.06%及 94.23%。在行业方面，权重较高的金融股涨幅最小，在一定程度上拖累了大盘的表现；而计算机、轻工制造、纺织服装等小盘股居多的行业则涨幅最高。

中证 500 沪市 ETF：本基金标的指数中证 500 沪市指数上涨 60.93%，涨幅高于大盘。上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均相对平稳。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。本报告期年化跟踪误差 1.65%，日均偏离度 0.07%，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

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 2.580 元，本报告期基金份额净值增长率为 55.89%，同期业绩比较基准收益率为 60.93%，低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，宏观经济形势扭转的可能性不大，即便基建等投资项目资金到位，也只能起到托底的作用。经济转型虽然已经起步，但前路漫漫，不可能一蹴而就。在经济筑底期，货币政策和财政政策转向的可能性很小。货币政策总体基调仍将宽松，但受流动性陷阱和主周期抬头的影响，宽松的力道可能会低于预期；财政政策的力度则会进一步加大，通过改善总需求来稳增长。

踏入下半年，股票市场正在经历前所未有的大调整，速度和幅度都远超市场预期。展望后市，之前牛市的大背景并未改变，中国经济依然需要转型，整体货币政策仍旧宽松，房地产的投资属性正在消退，股市还是最有吸引力的投资场所，所以我们对股票市场的未来并不悲观。

在国家的强力介入下，流动性危机已基本解除，但重建市场信心需要一定过程。经历了刻骨铭心的调整后，投资者将会更加理性，之前市场的全面疯狂很难再现，股票走势也会更加贴合公司内在价值。吹尽狂沙始到金，在股市的起伏之中，股市自身也会完成结构调整，真正优质的股票尽管也被错杀，但在市场重见光明后也将会脱颖而出。

中证 500 沪市 ETF：组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力实现跟踪误差的最小化。

4.6 管理人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、专户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、风险管理部和专户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，曾于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金已按法律法规相关规定向中国证监会报告清盘解决方案，本基金管理人后续将根据法规规定对该事项的最新进展进行信息披露。

§ 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	377,483.86	454,643.18
结算备付金		113,028.05	-
存出保证金		77.07	492.46
交易性金融资产	6.4.2.2	12,453,333.50	9,747,728.89
其中：股票投资		12,453,333.50	9,747,728.89
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	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		413,534.80	11,326.13
应收利息	6.4.2.5	425.05	124.41
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		13,357,882.33	10,214,315.07

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17,760.33	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,323.21	3,977.96
应付托管费		1,064.65	795.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	6,976.27	2,617.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	276,188.48	180,791.00
负债合计		307,312.94	188,181.77
所有者权益:			
实收基金	6.4.2.9	5,058,261.00	6,058,261.00
未分配利润	6.4.2.10	7,992,308.39	3,967,872.30
所有者权益合计		13,050,569.39	10,026,133.30
负债和所有者权益总计		13,357,882.33	10,214,315.07

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.580 元，基金份额总额 5,058,261.00 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		610,860.15	1,529,941.65
1. 利息收入		2,042.69	2,670.32
其中：存款利息收入	6.4.2.11	2,042.69	2,670.32
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		918,575.08	2,280,972.88
其中：股票投资收益	6.4.2.12	883,018.00	2,218,987.62
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.2.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.2.14	-	-
衍生工具收益	6.4.2.15	-	-
股利收益	6.4.2.16	35,557.08	61,985.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	-301,183.74	-767,793.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.18	-8,573.88	14,092.22
减：二、费用		336,865.09	261,280.00
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	23,532.91	39,594.10
2. 托管费	6.4.5.2.2	4,706.56	7,918.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.19	10,885.14	9,955.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.2.20	297,740.48	203,811.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		273,995.06	1,268,661.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		273,995.06	1,268,661.65

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	6,058,261.00	3,967,872.30	10,026,133.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	273,995.06	273,995.06
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	-1,000,000.00	3,750,441.03	2,750,441.03

列)			
其中：1. 基金申购款	295,000,000.00	591,286,321.28	886,286,321.28
2. 基金赎回款	-296,000,000.00	-587,535,880.25	-883,535,880.25
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）	5,058,261.00	7,992,308.39	13,050,569.39
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	51,058,261.00	9,661,748.04	60,720,009.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,268,661.65	1,268,661.65
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）	-44,000,000.00	-9,437,923.38	-53,437,923.38
其中：1. 基金申购款	45,000,000.00	9,268,435.14	54,268,435.14
2. 基金赎回款	-89,000,000.00	-18,706,358.52	-107,706,358.52
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）	7,058,261.00	1,492,486.31	8,550,747.31

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

基金管理人负责人

肖剑

主管会计工作负责人

范瑛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 会计政策和会计估计变更的说明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.2 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	377,483.86
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	377,483.86

6.4.2.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,411,274.35	12,453,333.50	42,059.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,411,274.35	12,453,333.50	42,059.15

6.4.2.3 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。

6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	379.11
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	45.94
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	425.05

6.4.2.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,976.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,976.27

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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
应付替代款	3,405.60
可退替代款	34,347.40
预提费用	188,435.48
合计	276,188.48

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,058,261.00	6,058,261.00
本期申购	295,000,000.00	295,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-296,000,000.00	-296,000,000.00
本期末	5,058,261.00	5,058,261.00

6.4.2.10 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	6,303,668.72	-2,335,796.42	3,967,872.30
本期利润	575,178.80	-301,183.74	273,995.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1,181,378.88	4,931,819.91	3,750,441.03
其中：基金申购款	636,784,676.83	-45,498,355.55	591,286,321.28
基金赎回款	-637,966,055.71	50,430,175.46	-587,535,880.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,697,468.64	2,294,839.75	7,992,308.39

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,826.85
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	213.51
其他	2.33
合计	2,042.69

6.4.2.12 股票投资收益

6.4.2.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	272,888.61
股票投资收益——赎回差价收入	610,129.39
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	883,018.00

6.4.2.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	3,099,139.92
减：卖出股票成本总额	2,826,251.31
买卖股票差价收入	272,888.61

6.4.2.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	883,535,880.25
减：现金支付赎回款总额	127,050,339.25
减：赎回股票成本总额	755,875,411.61
赎回差价收入	610,129.39

6.4.2.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.2.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.2.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.2.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	35,557.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,557.08

6.4.2.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-300,453.74
——股票投资	-300,453.74
——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. 可退替代款	-730.00

合计	-301,183.74
----	-------------

6.4.2.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-8,573.88
合计	-8,573.88

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。

6.4.2.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,885.14
银行间市场交易费用	-
合计	10,885.14

6.4.2.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	105.00
指数使用费	100,000.00
债券托管帐户维护费	9,000.00
其他	200.00
合计	297,740.48

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。

6.4.2.21 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。

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金申赎代办券商
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行交易。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,532.91	39,594.10
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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,706.56	7,918.77

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。

6.4.5.3 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。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度可比期间未投资本基金。

6.4.5.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	377,483.86	1,826.85	457,813.23	2,531.62

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。

6.4.5.6 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。

6.4.5.7 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。

6.4.6 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.7 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
600410	华胜天成	2015-5-28	重大事项停牌	47.84	2015-7-22	43.06	3,550	158,018.52	169,832.00	-
600110	中科英华	2015-6-26	重大事项停牌	13.73	-	-	11,052	149,451.07	151,743.96	-
600645	中源协和	2015-4-28	重大事项停牌	79.34	-	-	1,220	87,746.59	96,794.80	-
601718	际华集团	2015-6-17	重大事项停牌	15.12	2015-7-2	13.61	6,400	96,483.35	96,768.00	-
600654	中安消	2015-6-29	重大事项停牌	30.91	-	-	2,839	91,037.61	87,753.49	-
600872	中炬高新	2015-5-4	重大事项停牌	21.62	-	-	3,695	44,540.02	79,885.90	-
600482	风帆股份	2015-5-28	重大事项停牌	42.38	-	-	1,761	68,309.39	74,631.18	-
600643	爱建股份	2015-6-30	重大事项停牌	16.73	-	-	4,205	76,949.20	70,349.65	-
600879	航天电子	2015-5-15	重大事项停牌	24.50	-	-	2,771	64,380.66	67,889.50	-
600587	新华医疗	2015-5-22	重大事项停牌	58.63	2015-7-3	52.77	984	50,926.83	57,691.92	-
600175	美都能源	2015-6-29	重大事项停牌	10.64	2015-7-20	9.58	5,280	57,759.36	56,179.20	-
600499	科达洁能	2015-6-10	重大事项停牌	29.64	-	-	1,700	49,730.63	50,388.00	-
600967	北方创业	2015-4-13	重大事项停牌	17.12	-	-	2,800	41,199.36	47,936.00	-
601311	骆驼股份	2015-6-18	重大事项停牌	28.20	2015-7-15	25.38	1,693	47,825.53	47,742.60	-
600366	宁波韵升	2015-5-22	重大事项停牌	35.09	2015-8-12	31.58	1,219	37,849.57	42,774.71	-
600416	湘电股份	2015-5-22	重大事项停牌	22.64	2015-7-20	20.35	1,590	32,202.49	35,997.60	-

600790	轻纺城	2015-5-25	重大事项停牌	13.38	2015-8-18	12.04	2,321	27,093.46	31,054.98	-
600312	平高电气	2015-6-23	重大事项停牌	22.58	-	-	1,331	31,253.37	30,053.98	-
600335	国机汽车	2015-6-15	重大事项停牌	37.93	2015-7-21	34.14	655	24,479.99	24,844.15	-
600869	智慧能源	2015-5-11	重大事项停牌	29.14	2015-7-31	26.23	804	18,653.23	23,428.56	-
600702	沱牌舍得	2015-6-29	重大事项停牌	26.11	2015-8-20	28.00	638	16,964.91	16,658.18	-
600575	皖江物流	2014-10-8	重大事项停牌	4.11	-	-	3,900	15,006.24	16,029.00	-
600333	长春燃气	2015-5-29	重大事项停牌	11.97	2015-7-9	10.77	1,230	15,463.75	14,723.10	-
600078	澄星股份	2015-6-9	重大事项停牌	15.23	2015-7-1	13.71	840	13,563.22	12,793.20	-
600978	宜华木业	2015-6-18	重大事项停牌	22.44	-	-	127	2,828.50	2,849.88	-

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.3.2 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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 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的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、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审计和风险控制委员会，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其他原因，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。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 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，除附注 6.4.7.2 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。

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	377,483.86	-	-	-	377,483.86
结算备付金	113,028.05	-	-	-	113,028.05
存出保证金	77.07	-	-	-	77.07
交易性金融资产	-	-	-	12,453,333.50	12,453,333.50
应收证券清算款	-	-	-	413,534.80	413,534.80
应收利息	-	-	-	425.05	425.05
资产总计	490,588.98	-	-	12,867,293.35	13,357,882.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,760.33	17,760.33
应付管理人报酬	-	-	-	5,323.21	5,323.21
应付托管费	-	-	-	1,064.65	1,064.65
应付交易费用	-	-	-	6,976.27	6,976.27
其他负债	-	-	-	276,188.48	276,188.48
负债总计	-	-	-	307,312.94	307,312.94
利率敏感度缺口	490,588.98	-	-	12,559,980.41	13,050,569.39

上年度末 2014 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	454,643.18	-	-	-	454,643.18
存出保证金	492.46	-	-	-	492.46
交易性金融资产	-	-	-	9,747,728.89	9,747,728.89
应收证券清算款	-	-	-	11,326.13	11,326.13
应收利息	-	-	-	124.41	124.41
资产总计	455,135.64	-	-	9,759,179.43	10,214,315.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,977.96	3,977.96
应付托管费	-	-	-	795.58	795.58
应付交易费用	-	-	-	2,617.23	2,617.23
其他负债	-	-	-	180,791.00	180,791.00
负债总计	-	-	-	188,181.77	188,181.77
利率敏感度缺口	455,135.64	-	-	9,570,997.66	10,026,133.30

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数型证券投资基金，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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.4.3 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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于 2015 年 06 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	12,453,333.50	95.42	9,747,728.89	97.22
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	12,453,333.50	95.42	9,747,728.89	97.22

6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。

假设	1. 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2. 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	3. Beta 系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	中证 500 沪市指数上升 5%	636,373.99	478,295.56
	中证 500 沪市指数下降 5%	-636,373.99	-478,295.56

6.4.9 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	12,453,333.50	93.23
	其中：股票	12,453,333.50	93.23
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	490,511.91	3.67
7	其他各项资产	414,036.92	3.10
8	合计	13,357,882.33	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	采矿业	217,341.00	1.67
C	制造业	7,078,253.81	54.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	447,385.27	3.43
E	建筑业	278,983.86	2.14
F	批发和零售业	1,187,977.09	9.10
G	交通运输、仓储和邮政业	662,837.87	5.08
H	住宿和餐饮业	29,800.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	721,152.02	5.53
J	金融业	152,702.11	1.17
K	房地产业	826,901.45	6.34
L	租赁和商务服务业	117,502.66	0.90
M	科学研究和技术服务业	131,654.80	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	38,907.96	0.30
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	250,556.70	1.92
S	综合	311,376.90	2.39
	合计	12,453,333.50	95.42

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600410	华胜天成	3,550	169,832.00	1.30
2	600110	中科英华	11,052	151,743.96	1.16
3	600881	亚泰集团	9,600	122,016.00	0.93
4	600895	张江高科	4,100	119,351.00	0.91
5	600037	歌华有线	3,682	115,983.00	0.89
6	600376	首开股份	5,900	113,811.00	0.87
7	600737	中粮屯河	5,454	113,497.74	0.87
8	600446	金证股份	900	111,114.00	0.85
9	600435	北方导航	2,400	108,888.00	0.83
10	600201	金宇集团	1,500	106,680.00	0.82
11	600219	南山铝业	10,400	104,936.00	0.80
12	600601	方正科技	11,500	104,650.00	0.80
13	600635	大众公用	10,379	101,506.62	0.78
14	600158	中体产业	3,501	100,303.65	0.77
15	600645	中源协和	1,220	96,794.80	0.74
16	601718	际华集团	6,400	96,768.00	0.74
17	600143	金发科技	8,100	96,552.00	0.74
18	600500	中化国际	5,500	96,140.00	0.74
19	600525	长园集团	4,665	95,959.05	0.74
20	600200	江苏吴中	2,600	95,550.00	0.73
21	600021	上海电力	4,459	94,084.90	0.72
22	600594	益佰制药	1,600	93,008.00	0.71
23	600026	中海发展	7,157	91,895.88	0.70
24	600320	振华重工	8,700	91,350.00	0.70
25	600079	人福医药	2,400	88,920.00	0.68
26	601012	隆基股份	5,600	88,144.00	0.68
27	600654	中安消	2,839	87,753.49	0.67
28	600811	东方集团	7,000	86,310.00	0.66

29	600655	豫园商城	5,300	85,065.00	0.65
30	600797	浙大网新	4,400	83,116.00	0.64
31	600694	大商股份	1,500	82,920.00	0.64
32	600198	大唐电信	2,325	82,398.00	0.63
33	600816	安信信托	1,653	82,352.46	0.63
34	600122	宏图高科	4,900	80,458.00	0.62
35	600872	中炬高新	3,695	79,885.90	0.61
36	600770	综艺股份	4,069	79,508.26	0.61
37	600584	长电科技	4,152	79,344.72	0.61
38	600169	太原重工	8,900	79,210.00	0.61
39	600787	中储股份	4,916	79,147.60	0.61
40	600521	华海药业	2,513	78,531.25	0.60
41	600675	中华企业	6,927	78,344.37	0.60
42	600511	国药股份	1,544	77,802.16	0.60
43	600482	风帆股份	1,761	74,631.18	0.57
44	600651	飞乐音响	3,615	74,360.55	0.57
45	600704	物产中大	3,109	74,242.92	0.57
46	600125	铁龙物流	4,800	74,064.00	0.57
47	600151	航天机电	4,601	73,754.03	0.57
48	600428	中远航运	4,484	72,595.96	0.56
49	600522	中天科技	3,181	72,304.13	0.55
50	600664	哈药股份	6,000	72,240.00	0.55
51	600058	五矿发展	2,200	71,874.00	0.55
52	600498	烽火通信	2,700	71,442.00	0.55
53	600171	上海贝岭	2,903	70,978.35	0.54
54	601608	中信重工	4,343	70,790.90	0.54
55	600643	爱建股份	4,205	70,349.65	0.54
56	600685	广船国际	1,300	69,862.00	0.54
57	600759	洲际油气	4,514	68,973.92	0.53
58	600755	厦门国贸	6,103	68,597.72	0.53
59	600240	华业地产	4,480	68,364.80	0.52
60	600765	中航重机	2,490	68,300.70	0.52
61	600879	航天电子	2,771	67,889.50	0.52
62	600436	片仔癀	1,000	66,670.00	0.51
63	600808	马钢股份	12,500	66,500.00	0.51
64	600426	华鲁恒升	3,530	65,516.80	0.50
65	600528	中铁二局	3,900	65,403.00	0.50
66	600017	日照港	8,038	65,188.18	0.50
67	600611	大众交通	3,900	64,935.00	0.50

68	600673	东阳光科	6,494	64,225.66	0.49
69	601000	唐山港	4,639	63,507.91	0.49
70	600056	中国医药	2,608	63,478.72	0.49
71	600325	华发股份	3,461	62,644.10	0.48
72	600880	博瑞传播	4,000	62,120.00	0.48
73	600176	中国巨石	2,287	61,886.22	0.47
74	600220	江苏阳光	7,457	61,818.53	0.47
75	600433	冠豪高新	4,000	61,560.00	0.47
76	600517	置信电气	3,921	61,363.65	0.47
77	600187	国中水务	7,600	59,280.00	0.45
78	600478	科力远	3,450	58,719.00	0.45
79	600587	新华医疗	984	57,691.92	0.44
80	600805	悦达投资	3,595	56,189.85	0.43
81	600175	美都能源	5,280	56,179.20	0.43
82	600835	上海机电	1,694	55,800.36	0.43
83	601717	郑煤机	5,100	55,641.00	0.43
84	600270	外运发展	1,904	55,520.64	0.43
85	600064	南京高科	2,846	55,497.00	0.43
86	600409	三友化工	4,875	55,087.50	0.42
87	600418	江淮汽车	3,900	54,912.00	0.42
88	600487	亨通光电	1,492	54,905.60	0.42
89	600138	中青旅	2,589	54,679.68	0.42
90	600557	康缘药业	1,952	54,324.16	0.42
91	600120	浙江东方	1,600	54,224.00	0.42
92	600067	冠城大通	5,420	53,766.40	0.41
93	600699	均胜电子	1,400	53,634.00	0.41
94	600422	昆药集团	1,450	53,548.50	0.41
95	600536	中国软件	1,500	53,220.00	0.41
96	600160	巨化股份	4,800	52,896.00	0.41
97	600812	华北制药	4,356	52,881.84	0.41
98	600161	天坛生物	1,404	52,874.64	0.41
99	603766	隆鑫通用	2,100	52,710.00	0.40
100	600183	生益科技	5,145	52,427.55	0.40
101	600006	东风汽车	4,128	52,343.04	0.40
102	600580	卧龙电气	2,928	52,206.24	0.40
103	600039	四川路桥	7,936	51,822.08	0.40
104	600458	时代新材	2,037	51,128.70	0.39
105	600481	双良节能	2,107	50,462.65	0.39
106	600499	科达洁能	1,700	50,388.00	0.39

107	600851	海欣股份	3,907	49,462.62	0.38
108	600614	鼎立股份	1,635	48,853.80	0.37
109	600380	健康元	3,169	48,042.04	0.37
110	600967	北方创业	2,800	47,936.00	0.37
111	600572	康恩贝	2,106	47,806.20	0.37
112	600284	浦东建设	2,929	47,771.99	0.37
113	601311	骆驼股份	1,693	47,742.60	0.37
114	600859	王府井	1,500	47,250.00	0.36
115	600289	亿阳信通	2,359	47,014.87	0.36
116	600267	海正药业	2,500	46,975.00	0.36
117	601666	平煤股份	6,200	46,934.00	0.36
118	600062	华润双鹤	1,800	46,872.00	0.36
119	600216	浙江医药	3,500	46,480.00	0.36
120	600825	新华传媒	2,741	45,473.19	0.35
121	600300	维维股份	4,400	44,660.00	0.34
122	600546	山煤国际	5,200	44,252.00	0.34
123	600757	长江传媒	3,171	44,076.90	0.34
124	600736	苏州高新	3,814	43,441.46	0.33
125	600885	宏发股份	1,383	43,343.22	0.33
126	603019	中科曙光	500	43,295.00	0.33
127	600545	新疆城建	2,866	43,018.66	0.33
128	600366	宁波韵升	1,219	42,774.71	0.33
129	600826	兰生股份	1,102	42,570.26	0.33
130	600747	大连控股	5,368	42,568.24	0.33
131	600884	杉杉股份	1,485	42,471.00	0.33
132	600970	中材国际	2,900	42,398.00	0.32
133	600004	白云机场	2,473	41,793.70	0.32
134	600180	瑞茂通	1,434	41,098.44	0.31
135	600259	广晟有色	700	41,062.00	0.31
136	601369	陕鼓动力	3,500	40,985.00	0.31
137	601001	大同煤业	4,400	40,656.00	0.31
138	600112	天成控股	2,138	40,622.00	0.31
139	600260	凯乐科技	2,449	40,286.05	0.31
140	600509	天富能源	2,850	40,099.50	0.31
141	601233	桐昆股份	2,000	39,920.00	0.31
142	600596	新安股份	2,857	39,826.58	0.31
143	601002	晋亿实业	2,508	39,676.56	0.30
144	600993	马应龙	1,223	39,246.07	0.30
145	600059	古越龙山	2,560	39,219.20	0.30

146	600351	亚宝药业	2,887	39,089.98	0.30
147	600292	中电远达	1,274	38,907.96	0.30
148	601880	大连港	5,300	38,160.00	0.29
149	600761	安徽合力	2,279	38,127.67	0.29
150	601908	京运通	1,807	37,910.86	0.29
151	600298	安琪酵母	1,072	37,284.16	0.29
152	600261	阳光照明	4,563	37,097.19	0.28
153	600748	上实发展	2,348	36,746.20	0.28
154	600628	新世界	2,181	36,531.75	0.28
155	600823	世茂股份	2,800	36,484.00	0.28
156	600416	湘电股份	1,590	35,997.60	0.28
157	600460	士兰微	3,900	35,997.00	0.28
158	603077	和邦股份	1,728	35,942.40	0.28
159	600894	广日股份	1,800	35,928.00	0.28
160	601886	江河创建	2,400	35,712.00	0.27
161	601139	深圳燃气	3,400	35,700.00	0.27
162	600831	广电网络	2,095	35,552.15	0.27
163	600586	金晶科技	5,155	35,466.40	0.27
164	600566	济川药业	1,200	35,376.00	0.27
165	600496	精工钢构	4,823	35,256.13	0.27
166	600729	重庆百货	1,086	34,947.48	0.27
167	601005	重庆钢铁	6,100	34,709.00	0.27
168	600720	祁连山	3,270	34,629.30	0.27
169	600251	冠农股份	2,478	34,270.74	0.26
170	600639	浦东金桥	1,375	33,398.75	0.26
171	600776	东方通信	2,002	33,012.98	0.25
172	601678	滨化股份	3,648	32,722.56	0.25
173	601126	四方股份	1,057	32,238.50	0.25
174	600750	江中药业	998	32,125.62	0.25
175	600073	上海梅林	2,460	31,832.40	0.24
176	600640	号百控股	1,100	31,768.00	0.24
177	600790	轻纺城	2,321	31,054.98	0.24
178	600195	中牧股份	1,102	30,966.20	0.24
179	601777	力帆股份	1,952	30,822.08	0.24
180	600088	中视传媒	940	30,333.80	0.23
181	600312	平高电气	1,331	30,053.98	0.23
182	600337	美克家居	2,000	29,880.00	0.23
183	600754	锦江股份	1,000	29,800.00	0.23
184	600488	天药股份	3,061	29,661.09	0.23

185	600132	重庆啤酒	1,300	29,276.00	0.22
186	600874	创业环保	2,287	29,159.25	0.22
187	600636	三爱富	1,437	29,142.36	0.22
188	601801	皖新传媒	998	29,111.66	0.22
189	601010	文峰股份	2,938	28,704.26	0.22
190	600456	宝钛股份	1,100	28,677.00	0.22
191	601101	昊华能源	2,500	28,500.00	0.22
192	600425	青松建化	2,886	28,340.52	0.22
193	600086	东方金钰	526	28,283.02	0.22
194	600199	金种子酒	2,000	28,000.00	0.21
195	600329	中新药业	1,101	27,734.19	0.21
196	600997	开滦股份	3,200	27,584.00	0.21
197	600141	兴发集团	1,600	27,568.00	0.21
198	600537	亿晶光电	1,540	27,566.00	0.21
199	603699	纽威股份	1,100	27,489.00	0.21
200	600864	哈投股份	1,685	27,297.00	0.21
201	600429	三元股份	2,366	26,712.14	0.20
202	600657	信达地产	3,200	26,368.00	0.20
203	600773	西藏城投	1,478	26,027.58	0.20
204	600850	华东电脑	466	25,811.74	0.20
205	603188	亚邦股份	900	25,794.00	0.20
206	600803	新奥股份	1,500	25,665.00	0.20
207	600392	盛和资源	1,004	25,612.04	0.20
208	600510	黑牡丹	1,650	25,608.00	0.20
209	600617	国新能源	1,400	25,578.00	0.20
210	600507	方大特钢	2,800	25,312.00	0.19
211	603555	贵人鸟	600	25,068.00	0.19
212	600280	中央商场	1,800	24,966.00	0.19
213	600335	国机汽车	655	24,844.15	0.19
214	603366	日出东方	1,672	24,578.40	0.19
215	600971	恒源煤电	2,600	23,790.00	0.18
216	600743	华远地产	2,930	23,527.90	0.18
217	600869	智慧能源	804	23,428.56	0.18
218	600780	通宝能源	2,400	23,304.00	0.18
219	600551	时代出版	1,053	22,860.63	0.18
220	600468	百利电气	960	22,377.60	0.17
221	601515	东风股份	1,100	22,220.00	0.17
222	601208	东材科技	1,930	22,040.60	0.17
223	600563	法拉电子	703	21,757.85	0.17

224	600397	安源煤业	2,100	20,307.00	0.16
225	603001	奥康国际	642	20,043.24	0.15
226	603005	晶方科技	400	19,564.00	0.15
227	601965	中国汽研	1,498	19,488.98	0.15
228	601226	华电重工	1,200	19,092.00	0.15
229	603169	兰石重装	1,000	18,490.00	0.14
230	600983	惠而浦	1,146	18,209.94	0.14
231	600387	海越股份	663	16,919.76	0.13
232	600702	沱牌舍得	638	16,658.18	0.13
233	601999	出版传媒	1,166	16,580.52	0.13
234	600184	光电股份	588	16,558.08	0.13
235	600403	大有能源	1,800	16,092.00	0.12
236	600575	皖江物流	3,900	16,029.00	0.12
237	603899	晨光文具	400	16,024.00	0.12
238	603698	航天工程	400	15,768.00	0.12
239	600389	江山股份	500	15,620.00	0.12
240	603328	依顿电子	500	15,330.00	0.12
241	600618	氯碱化工	1,100	14,938.00	0.11
242	603369	今世缘	400	14,836.00	0.11
243	600333	长春燃气	1,230	14,723.10	0.11
244	600078	澄星股份	840	12,793.20	0.10
245	600917	重庆燃气	900	11,376.00	0.09
246	600801	华新水泥	1,028	10,865.96	0.08
247	600978	宜华木业	127	2,849.88	0.02

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	600187	国中水务	216,146.00	2.16
2	600110	中科英华	138,793.00	1.38
3	600037	歌华有线	134,335.00	1.34
4	600446	金证股份	132,698.00	1.32
5	600601	方正科技	128,986.00	1.29

6	600401	海润光伏	118,152.00	1.18
7	600654	中安消	109,060.00	1.09
8	600436	片仔癀	102,979.76	1.03
9	600635	大众公用	91,546.20	0.91
10	600500	中化国际	86,437.00	0.86
11	600143	金发科技	80,813.00	0.81
12	600655	豫园商城	79,818.00	0.80
13	600198	大唐电信	79,021.00	0.79
14	600490	鹏欣资源	78,593.00	0.78
15	600594	益佰制药	78,142.46	0.78
16	600200	江苏吴中	74,812.00	0.75
17	600851	海欣股份	73,389.00	0.73
18	600079	人福医药	70,371.00	0.70
19	600522	中天科技	69,705.00	0.70
20	600831	广电网络	68,356.00	0.68

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

7.4.2 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	601519	大智慧	155,676.50	1.55
2	601099	太平洋	134,005.00	1.34
3	600820	隧道股份	105,212.00	1.05
4	600410	华胜天成	100,170.00	1.00
5	600522	中天科技	96,562.00	0.96
6	600582	天地科技	69,557.00	0.69
7	600654	中安消	63,727.00	0.64
8	601872	招商轮船	63,493.00	0.63
9	600098	广州发展	62,093.00	0.62
10	600266	北京城建	53,680.00	0.54
11	600259	广晟有色	51,798.00	0.52
12	600317	营口港	46,670.00	0.47
13	600438	通威股份	44,690.25	0.45
14	600844	丹化科技	41,130.77	0.41
15	600490	鹏欣资源	39,084.70	0.39
16	600201	金字集团	38,876.00	0.39

17	600759	洲际油气	38,625.00	0.39
18	600432	吉恩镍业	38,475.00	0.38
19	600704	物产中大	38,152.00	0.38
20	600280	中央商场	37,807.00	0.38

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

7.4.3 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	4,562,880.27
卖出股票收入（成交）总额	3,099,139.92

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 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	77.07
2	应收证券清算款	413,534.80
3	应收股利	-
4	应收利息	425.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	414,036.92

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	600410	华胜天成	169,832.00	1.30	重大事项停牌
2	600110	中科英华	151,743.96	1.16	重大事项停牌

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

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
514	9,840.97	382,913.00	7.57%	4,675,348.00	92.43%

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	王仰东	518,800.00	10.26%
2	陈育贵	176,700.00	3.49%
3	陈挺	149,226.00	2.95%
4	李艳芳	137,400.00	2.72%
5	富安达基金—海通证券—富安达—东海恒信 7 期资产管理计划	125,624.00	2.48%
6	鄢兴曾	113,600.00	2.25%
7	周莉莉	107,149.00	2.12%
8	李勇智	104,513.00	2.07%
9	中国银河证券股份有限公司	83,318.00	1.65%
10	招商证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	76,400.00	1.51%

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%

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	6,058,261.00
本报告期基金总申购份额	295,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	296,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5,058,261.00

§ 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、报告期内基金管理人重大人事变动：

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 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一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 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一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 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六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 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七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司

副总经理。

二、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
招商证券	2	7,662,020.19	100.00%	6,976.27	100.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

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

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

本报告期内本基金新增席位：长城证券。

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

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/13
2	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
3	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21
4	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
6	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/28
7	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/30
8	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/2
9	大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
10	大成基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/25
11	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28

12	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
13	大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
14	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（2015 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
15	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摘要（2015 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
16	中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/18
17	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/5
18	大成基金管理有限公司关于调整网上直销银联支付交易费率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
19	关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/15
20	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/16
21	大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为开放式基金代销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	2015/5/19
22	关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/24

§ 11 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

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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
2015 年 8 月 27 日