

深证成长 40 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	33

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	33
7.12 投资组合报告附注	34
§ 8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末上市基金前十名持有人	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	35
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	35
§ 9 开放式基金份额变动	35
§ 10 重大事件揭示	36
10.1 基金份额持有人大会决议	36
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	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	37
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	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8 其他重大事件	39
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	40
§ 12 备查文件目录	40
12.1 备查文件目录	40
12.2 存放地点	40
12.3 查阅方式	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成深证成长 40ETF
场内简称	深成长
基金主代码	159906
交易代码	159906
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 21 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	241,639,725.00 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	2011 年 2 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求与标的指数相似的投资回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数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	深证成长 40 价格指数
风险收益特征	本金属股票基金，预期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，主要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	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@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	刘士余

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	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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部

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深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

§ 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	404,073,395.82
本期利润	411,975,006.97
加权平均基金份额本期利润	0.6420
本期加权平均净值利润率	62.23%
本期基金份额净值增长率	66.84%
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	67,290,960.12
期末可供分配基金份额利润	0.2785
期末基金资产净值	308,930,685.12
期末基金份额净值	1.278
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	27.80%

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

2. 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

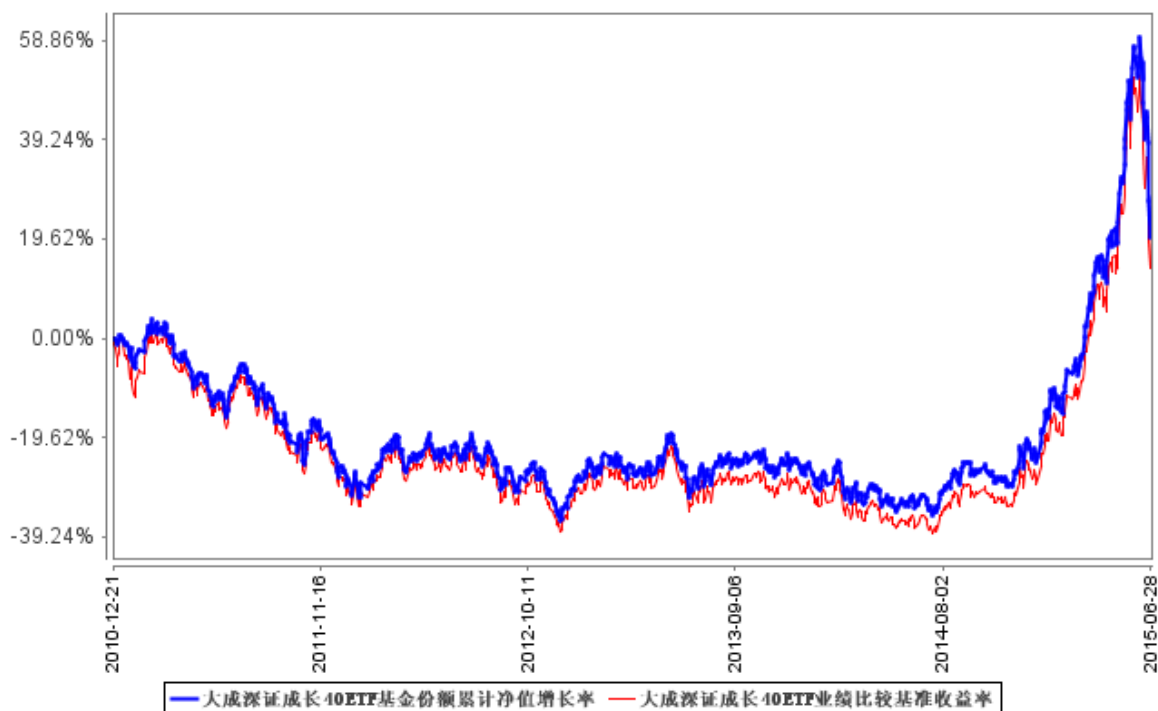
低于所列数字。

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	-12.88%	3.73%	-13.13%	3.92%	0.25%	-0.19%
过去三个月	15.97%	2.75%	16.68%	2.92%	-0.71%	-0.17%
过去六个月	66.84%	2.29%	69.29%	2.40%	-2.45%	-0.11%
过去一年	85.22%	1.82%	88.60%	1.89%	-3.38%	-0.07%
过去三年	66.19%	1.48%	64.08%	1.52%	2.11%	-0.04%
自基金合同生效起至今	27.80%	1.40%	22.40%	1.46%	5.40%	-0.06%

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起 3 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

§ 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,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)、大成月添利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		
谌湛先生	本基金基金经理	2014年9月12日	2015年5月22日	6年	金融工程硕士。2009年加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、数量投资分析师。2013年1月4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助理。2013年9月12日至2015年5月22日担任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2014年9月12日至2015年5月22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。具有基金从业资格。国籍：中国
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年5月23日	-	5年	会计学硕士。2010年7月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015年1月14日担任大成优选股票型证券投资基金（LOF）和大成沪深300指数证券投资基金基金经理助理。2015年2月28日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年5月23日起任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、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及大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 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》、《深证成长 40 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，深证成长 40 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。基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差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些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

中国经济从投资驱动向以新兴产业为支柱转型，同时配合货币政策的宽松、国企改革、“一带一路”的国家战略、以及人民币国际化进程的推进，共同造就了从去年下半年开始的牛市行情。虽然 6 月中下旬股市大幅回调，但上半年各指数仍收获巨额累计涨幅，沪深 300 上涨 26.58%，创业板上涨 94.23%，代表新兴产业的 TMT 行业涨幅居前。

报告期内本基金基本保持高仓位运作，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。上半年基金年化跟踪误差 3.77%，日均偏离度 0.16%，主要由于二季度持仓股票停牌个数较多，使基金规模变动时，无法调整相应个股权重，加上市场剧烈波动，导致基金跟踪误差加大。

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1.278 元，本报告期基金份额净值增长率为66.84%，同期业绩比较基准收益率为69.29%，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

产业转型和流动性宽松是本轮牛市的两大根基，在这两个条件未变的情况下牛市难言结束。虽然各主要指数距高点已大幅回调，但创业板、中小板估值仍偏高，下半年市场波动会加大，有业绩支持的龙头成长股和受益于改革政策的蓝筹股是更稳健的投资标的。

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一大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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：深证成长 40 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	2,969,985.75	24,283,157.59
结算备付金		95,526.78	-
存出保证金		33,546.16	12,154.91
交易性金融资产	6.4.2.2	301,610,771.58	724,817,183.49
其中：股票投资		301,610,771.58	724,817,183.49
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		4,976,692.76	20,354,195.62
应收利息	6.4.2.5	685.69	2,139.97
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		309,687,208.72	769,468,831.58
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		163,503.62	337,065.91
应付托管费		32,700.74	67,413.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	182,142.18	185,367.00
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	378,177.06	487,671.84
负债合计		756,523.60	1,077,517.93
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	241,639,725.00	1,003,639,725.00
未分配利润	6.4.2.10	67,290,960.12	-235,248,411.35
所有者权益合计		308,930,685.12	768,391,313.65
负债和所有者权益总计		309,687,208.72	769,468,831.58

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.278 元，基金份额总额 241,639,725.00 份。

6.2 利润表

会计主体：深证成长 40 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		414,890,054.16	-81,913,115.43
1. 利息收入		36,248.77	52,166.29
其中：存款利息收入	6.4.2.11	36,248.77	52,166.29
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）		406,927,971.50	-64,485,896.18
其中：股票投资收益	6.4.2.12	405,034,131.61	-74,840,398.11
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	6.4.2.13.2	-	-
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	1,893,839.89	10,354,501.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	7,901,611.15	-17,472,743.54
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	24,222.74	-6,642.00
减：二、费用		2,915,047.19	3,623,159.71
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	1,652,500.38	2,315,764.02
2. 托管费	6.4.5.2.2	330,499.99	463,152.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.19	600,457.35	462,927.51

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	331,589.47	381,315.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		411,975,006.97	-85,536,275.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		411,975,006.97	-85,536,275.14

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成长 40 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）	1,003,639,725.00	-235,248,411.35	768,391,313.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	411,975,006.97	411,975,006.97
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）	-762,000,000.00	-109,435,635.50	-871,435,635.50
其中：1. 基金申购款	94,000,000.00	31,321,030.75	125,321,030.75
2. 基金赎回款	-856,000,000.00	-140,756,666.25	-996,756,666.25
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）	241,639,725.00	67,290,960.12	308,930,685.12
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）	1,453,639,725.00	-360,584,016.04	1,093,055,708.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-85,536,275.14	-85,536,275.14
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）	-208,000,000.00	59,574,873.63	-148,425,126.37
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	-5,487,356.16	12,512,643.84
2. 基金赎回款	-226,000,000.00	65,062,229.79	-160,937,770.21

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)	1,245,639,725.00	-386,545,417.55	859,094,307.45

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 肖剑 范瑛
 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 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

对于在证券交易所上市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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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	2,969,985.75
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,969,985.75

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	220,875,604.78	301,610,771.58	80,735,166.80
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	220,875,604.78	301,610,771.58	80,735,166.80

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工具。

6.4.2.4 买入返售金融资产

6.4.2.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.2.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	630.23
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	41.87
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	13.59
合计	685.69

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	182,142.18

银行间市场应付交易费用	-
合计	182,142.18

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	37,786.79
预提费用	323,149.47
应付替代款	-
可退替代款	17,240.80
合计	378,177.06

注：1、应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

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	1,003,639,725.00	1,003,639,725.00
本期申购	94,000,000.00	94,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-856,000,000.00	-856,000,000.00
本期末	241,639,725.00	241,639,725.00

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	-331,894,419.87	96,646,008.52	-235,248,411.35
本期利润	404,073,395.82	7,901,611.15	411,975,006.97
本期基金份额交易产生的变动数	72,991,721.44	-182,427,356.94	-109,435,635.50
其中：基金申购款	17,055,560.38	14,265,470.37	31,321,030.75
基金赎回款	55,936,161.06	-196,692,827.31	-140,756,666.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	145,170,697.39	-77,879,737.27	67,290,960.12

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	33,598.35
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	2,444.81
其他	205.61
合计	36,248.77

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	58,949,448.39
股票投资收益——赎回差价收入	346,084,683.22
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	405,034,131.61

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	214,854,752.68
减：卖出股票成本总额	155,905,304.29
买卖股票差价收入	58,949,448.39

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	996,756,666.25
减：现金支付赎回款总额	95,401,037.25
减：赎回股票成本总额	555,270,945.78
赎回差价收入	346,084,683.22

6.4.2.13 债券投资收益

6.4.2.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.2.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.2.14 贵金属投资收益

6.4.2.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末有贵金属投资。

6.4.2.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资。

6.4.2.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资。

6.4.2.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末有贵金属投资。

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	1,893,839.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,893,839.89

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	7,901,611.15
——股票投资	7,901,611.15
——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	7,901,611.15
----	--------------

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	24,222.74
合计	24,222.74

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	600,457.35
银行间市场交易费用	-
合计	600,457.35

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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	290.00
指数使用费	99,150.00
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	331,589.47

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年度人民币 300,000 元。

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

无。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

无。

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。

6.4.4.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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、基金销售机构
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（“大成深证成长 40ETF 联接”）	本基金的联接基金
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. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 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

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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	385,596,819.69	100.00%	176,177,844.70	58.35%

6.4.5.1.2 权证交易

无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	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	341,216.81	100.00%	182,140.93	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	155,900.52	58.35%	155,900.52	100.00%

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

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

6.4.5.2 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,652,500.38	2,315,764.02
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 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	330,499.99	463,152.85

注：支付基金托管人中国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 X 0.10% / 当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金总 份额的比例
大成深证成长 40ETF 联接	229,500,000.00	94.98%	959,500,000.00	95.60%

注：本基金的联接基金投资本基金的费率标准按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

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
	中国农业银行	2,969,985.75	33,598.35	34,411,938.24

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。

6.4.5.6 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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.6 利润分配情况

6.4.6.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配事项。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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	停牌日	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总额	备
------	----	-----	------	----	----	----	-------	----	--------	---

码	名称	期		估值单 价	日期	开盘 单价		成本总额		注
002310	东方 园林	2015 年 5 月 27 日	重大事项 停牌	38.30	-	-	304,163	6,176,185.42	11,649,442.90	-
000982	中银 绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项 停牌	4.64	-	-	1,811,774	8,169,327.85	8,406,631.36	-
002375	亚厦 股份	2015 年 6 月 17 日	重大事项 停牌	29.21	2015 年 7 月 20 日	26.29	247,192	3,637,249.46	7,220,478.32	-
300197	铁汉 生态	2015 年 6 月 16 日	重大事项 停牌	36.03	-	-	137,130	2,085,105.45	4,940,793.90	-
300228	富瑞 特装	2015 年 6 月 24 日	重大事项 停牌	90.91	2015 年 7 月 30 日	81.82	39,898	2,436,520.88	3,627,127.18	-
002416	爱施 德	2015 年 5 月 5 日	重大事项 停牌	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	134,082	1,945,259.47	2,771,474.94	-
300349	金卡 股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项 停牌	59.79	2015 年 8 月 19 日	53.81	37,657	1,077,327.71	2,251,512.03	-

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

于本报告期末，本基金无银行间市场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

于本报告期末，本基金无交易所市场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

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成长 40 价格指数，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，跟踪深证成长 40 价格指数，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(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。

6.4.8.2 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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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及存出保证金等。

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	2,969,985.75	-	-	-	2,969,985.75
结算备付金	95,526.78	-	-	-	95,526.78
存出保证金	33,546.16	-	-	-	33,546.16
交易性金融资产	-	-	-	301,610,771.58	301,610,771.58
应收证券清算款	-	-	-	4,976,692.76	4,976,692.76
应收利息	-	-	-	685.69	685.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,099,058.69	-	-	306,588,150.03	309,687,208.72

负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	163,503.62	163,503.62
应付托管费	-	-	-	32,700.74	32,700.74
应付交易费用	-	-	-	182,142.18	182,142.18
其他负债	-	-	-	378,177.06	378,177.06
负债总计	-	-	-	756,523.60	756,523.60
利率敏感度缺口	3,099,058.69	-	-	305,831,626.43	308,930,685.12
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	24,283,157.59	-	-	-	24,283,157.59
存出保证金	12,154.91	-	-	-	12,154.91
交易性金融资产	-	-	-	724,817,183.49	724,817,183.49
应收证券清算款	-	-	-	20,354,195.62	20,354,195.62
应收利息	-	-	-	2,139.97	2,139.97
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,295,312.50	-	-	745,173,519.08	769,468,831.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	337,065.91	337,065.91
应付托管费	-	-	-	67,413.18	67,413.18
应付交易费用	-	-	-	185,367.00	185,367.00
其他负债	-	-	-	487,671.84	487,671.84
负债总计	-	-	-	1,077,517.93	1,077,517.93
利率敏感度缺口	24,295,312.50	-	-	744,096,001.15	768,391,313.65

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

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 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(2014 年 12 月 31 日：同)。

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。

6.4.8.4.3 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长 40 价格指数，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，深证成长 40 价格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 90%。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。

6.4.8.4.3.1 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	301,610,771.58	97.63	724,817,183.49	94.33
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	301,610,771.58	97.63	724,817,183.49	94.33

6.4.8.4.3.2 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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	14,650,000.00	37,950,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-14,650,000.00	-37,950,000.00	

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	301,610,771.58	97.39
	其中：股票	301,610,771.58	97.39
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	3,065,512.53	0.99
7	其他各项资产	5,010,924.61	1.62
8	合计	309,687,208.72	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	-	0.00
C	制造业	189,782,863.51	61.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	36,089,814.98	11.68
F	批发和零售业	9,527,584.94	3.08
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	26,770,242.32	8.67
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	5,909,825.00	1.91
L	租赁和商务服务业	8,024,586.84	2.60
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	18,381,301.99	5.95
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	7,124,552.00	2.31
S	综合	-	0.00
	合计	301,610,771.58	97.63

注：含提前买入的指数备选成分股。

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有积极投资。

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	000651	格力电器	552,434	35,300,532.60	11.43
2	002415	海康威视	522,109	23,390,483.20	7.57
3	002450	康得新	496,256	15,185,433.60	4.92
4	000625	长安汽车	617,400	13,058,010.00	4.23
5	002310	东方园林	304,163	11,649,442.90	3.77
6	002241	歌尔声学	314,602	11,294,211.80	3.66
7	300070	碧水源	222,724	10,866,703.96	3.52
8	300104	乐视网	198,902	10,295,167.52	3.33
9	002081	金螳螂	344,994	9,725,380.86	3.15
10	300017	网宿科技	181,866	8,442,219.72	2.73
11	000982	中银绒业	1,811,774	8,406,631.36	2.72
12	002456	欧菲光	247,478	8,349,907.72	2.70
13	300058	蓝色光标	507,564	8,024,586.84	2.60
14	000826	桑德环境	193,227	7,514,598.03	2.43
15	002375	亚厦股份	247,192	7,220,478.32	2.34
16	300027	华谊兄弟	186,800	7,124,552.00	2.31
17	002236	大华股份	221,828	7,080,749.76	2.29
18	000413	东旭光电	712,664	6,969,853.92	2.26
19	300124	汇川技术	144,121	6,917,808.00	2.24
20	002471	中超电缆	246,663	6,657,434.37	2.16
21	002410	广联达	273,715	6,404,931.00	2.07
22	002475	立讯精密	180,646	6,107,641.26	1.98
23	002146	荣盛发展	472,786	5,909,825.00	1.91
24	002219	恒康医疗	123,000	5,468,580.00	1.77
25	300197	铁汉生态	137,130	4,940,793.90	1.60
26	300267	尔康制药	141,652	4,828,916.68	1.56
27	300146	汤臣倍健	110,430	4,337,690.40	1.40
28	002462	嘉事堂	73,500	3,902,850.00	1.26
29	300202	聚龙股份	93,582	3,780,712.80	1.22
30	300228	富瑞特装	39,898	3,627,127.18	1.17

31	300026	红日药业	159,314	3,575,006.16	1.16
32	300005	探路者	111,785	3,062,909.00	0.99
33	000626	如意集团	35,800	2,853,260.00	0.92
34	002416	爱施德	134,082	2,771,474.94	0.90
35	300134	大富科技	94,400	2,638,480.00	0.85
36	002663	普邦园林	263,270	2,553,719.00	0.83
37	002174	游族网络	26,200	2,430,312.00	0.79
38	000049	德赛电池	47,418	2,261,838.60	0.73
39	300349	金卡股份	37,657	2,251,512.03	0.73
40	300386	飞天诚信	11,346	1,627,924.08	0.53
41	000921	海信科龙	120,200	1,466,440.00	0.47
42	300298	三诺生物	34,657	1,334,641.07	0.43

注：含提前买入的指数备选成分股。

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有积极投资。

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	002415	海康威视	23,502,595.46	3.06
2	000651	格力电器	18,704,768.40	2.43
3	000625	长安汽车	12,744,061.17	1.66
4	000413	东旭光电	9,985,693.00	1.30
5	300027	华谊兄弟	6,384,398.60	0.83
6	002219	恒康医疗	4,807,740.00	0.63
7	002358	森源电气	4,635,048.99	0.60
8	002304	洋河股份	4,564,704.30	0.59
9	002146	荣盛发展	4,464,716.58	0.58
10	002450	康得新	4,047,139.82	0.53
11	002410	广联达	4,038,524.13	0.53
12	002310	东方园林	3,878,015.48	0.50
13	300058	蓝色光标	3,585,623.00	0.47
14	002241	歌尔声学	3,575,589.94	0.47
15	300070	碧水源	3,543,165.39	0.46

16	000587	金叶珠宝	3,482,415.50	0.45
17	300336	新文化	3,402,612.05	0.44
18	000826	桑德环境	3,229,168.68	0.42
19	002462	嘉事堂	3,195,593.00	0.42
20	002081	金螳螂	3,117,083.65	0.41

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	000333	美的集团	27,838,417.39	3.62
2	000587	金叶珠宝	16,974,349.93	2.21
3	002304	洋河股份	13,740,885.33	1.79
4	002415	海康威视	13,154,581.07	1.71
5	000826	桑德环境	11,461,807.64	1.49
6	300104	乐视网	9,853,711.00	1.28
7	002344	海宁皮城	9,683,385.84	1.26
8	300026	红日药业	9,065,860.03	1.18
9	002358	森源电气	8,869,336.26	1.15
10	000651	格力电器	8,721,287.00	1.14
11	002081	金螳螂	7,677,264.81	1.00
12	300017	网宿科技	7,310,112.31	0.95
13	300267	尔康制药	6,143,346.56	0.80
14	002241	歌尔声学	5,949,801.13	0.77
15	000568	泸州老窖	5,461,537.46	0.71
16	000970	中科三环	5,151,338.81	0.67
17	000661	长春高新	4,129,075.06	0.54
18	300298	三诺生物	4,024,957.72	0.52
19	002410	广联达	3,613,514.00	0.47
20	300005	探路者	3,552,413.65	0.46

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	170,742,067.01
卖出股票收入（成交）总额	214,854,752.68

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

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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	33,546.16
2	应收证券清算款	4,976,692.76
3	应收股利	-
4	应收利息	685.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,010,924.61

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	002310	东方园林	11,649,442.90	3.77	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

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
836	289,042.73	229,500,000.00	94.98%	12,139,725.00	5.02%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
农行一大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	229,500,000.00	94.98%

注：1、机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“农行一大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

2、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	贺凡	1,706,402.00	0.71%
2	张润全	831,000.00	0.34%
3	王迅	600,000.00	0.25%
4	袁宗喜	390,502.00	0.16%
5	郭力	300,000.00	0.12%
6	谭蓉	294,610.00	0.12%
7	王若英	270,000.00	0.11%
8	蒋晓谷	208,900.00	0.09%
9	张麟	196,801.00	0.08%
10	陈敏霞	178,500.00	0.07%
	农行一大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	229,500,000.00	94.98%

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

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（2010年12月21日）基金份额总额	498,639,725.00
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	1,003,639,725.00
本报告期基金总申购份额	94,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	856,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	241,639,725.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

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, 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	
光大证券	2	385,596,819.69	100.00%	341,216.81	100.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	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%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1. 本报告期内本基金退租交易单元：中信建投 1 个交易单元；新增交易单元：第一创业、山西证券各 1 个交易单元。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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。

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	深证成长 40 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	深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2014 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
9	深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2014 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
10	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
11	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
12	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
13	深证成长 40 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
14	深证成长 40 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
15	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
16	深证成长 40 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旗下基金持有的“汇川技术”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/22
18	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
19	大成基金管理有限公司关于调整网上直销通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

20	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
21	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
22	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
23	深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/26
24	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深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成长 40 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。

大成基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日