

大成中证 500 深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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
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 .....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	42
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 .....	42

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 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	2,507,615.00 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	2013-10-09

### 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	本基金标的指数为中证 500 深市价格指数
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	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		刘卓	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
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	2,059,041.28
本期利润	2,514,182.78
加权平均基金份额本期利润	0.9349
本期加权平均净值利润率	45.56%
本期基金份额净值增长率	71.20%
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	3,255,800.83
期末可供分配基金份额利润	1.2984
期末基金资产净值	6,216,136.40
期末基金份额净值	2.479

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	118.10%

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。

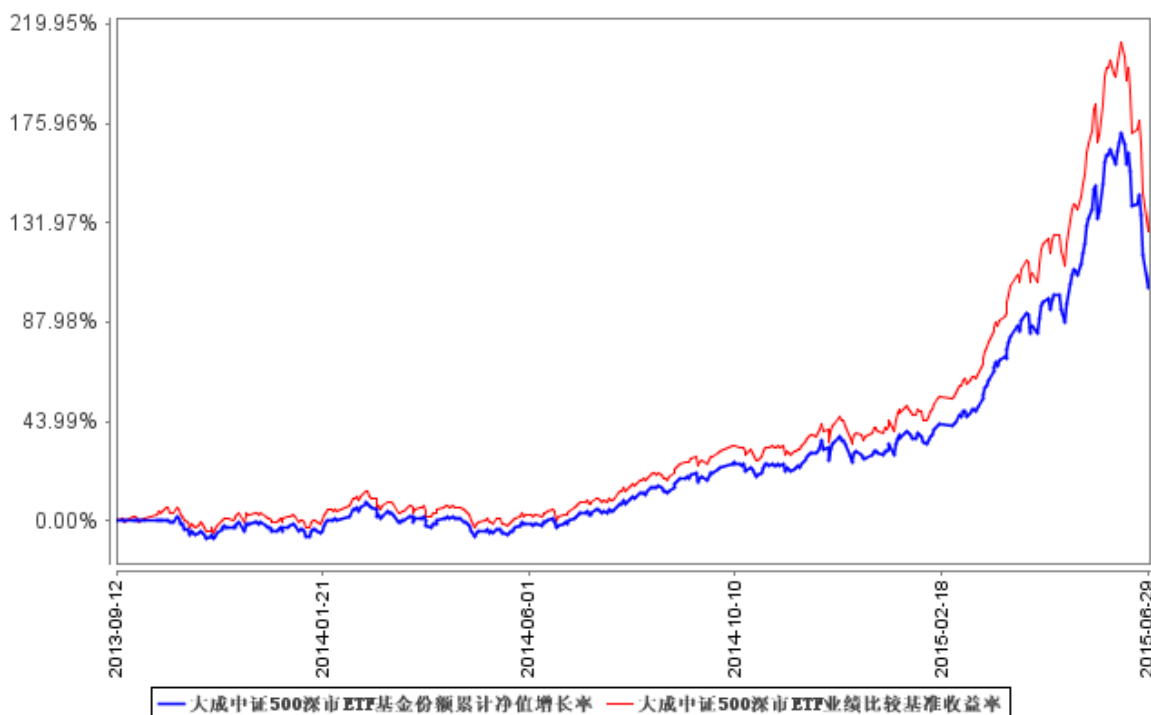
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

### 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	-9.23%	3.24%	-11.88%	3.74%	2.65%	-0.50%
过去三个月	25.21%	2.66%	24.46%	2.91%	0.75%	-0.25%
过去六个月	68.62%	2.10%	74.44%	2.28%	-5.82%	-0.18%
过去一年	113.06%	1.69%	126.16%	1.82%	-13.10%	-0.13%
自基金合同生效起至今	118.10%	1.62%	138.56%	1.62%	-20.46%	0.00%

### 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：1、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。截至本报告期本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

2、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金已于 2015 年 6 月 29 日（折算处理日）进行了基金份额折算。折算比例为：0.96223618。

## § 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		
湛湛先生	本基金基金经理	2013 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

					<p>联接基金基金经理助理。</p> <p>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</p>
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	5 年	<p>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。</p> <p>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</p>

#### 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》、《大成中证 500 深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，大成中证 500 深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。

#### 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 2.479 元,本报告期基金份额净值增长率为 68.62%,同期业绩比较基准收益率为 74.44%,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、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

本基金在本报告期内，于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日出现了连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满二百人以及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”）在对大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：大成中证 500 深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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.2.1	662,861.91	271,826.55
结算备付金		591.40	-
存出保证金		151.24	394.87
交易性金融资产	6.4.2.2	5,884,305.57	5,126,061.64
其中：股票投资		5,884,305.57	5,126,061.64
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		12,565.97	-
应收利息	6.4.2.5	119.51	362.76
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		6,560,595.60	5,398,645.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,012.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,041.61	3,089.40
应付托管费		608.31	617.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	2,373.80	1,709.20
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	338,435.48	170,000.00
负债合计		344,459.20	178,428.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.2.9	2,960,335.57	4,096,241.51
未分配利润	6.4.2.10	3,255,800.83	1,123,975.83
所有者权益合计		6,216,136.40	5,220,217.34
负债和所有者权益总计		6,560,595.60	5,398,645.82

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 2.479 元，基金份额总额 2,507,615.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深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
<b>一、收入</b>		2,823,287.63	3,476,462.23
1. 利息收入		1,441.62	4,897.29
其中：存款利息收入	6.4.2.11	1,441.62	4,893.83
债券利息收入		-	3.46
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）		2,365,070.64	2,606,355.09
其中：股票投资收益	6.4.2.12	2,345,565.83	2,526,610.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	-	239.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	19,504.81	79,505.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	455,141.50	863,944.92
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	1,633.87	1,264.93
<b>减：二、费用</b>		309,104.85	274,487.12
1. 管理人报酬		13,551.45	53,620.37
2. 托管费		2,710.29	10,724.07

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	4,332.63	10,837.40
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	288,510.48	199,305.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,514,182.78	3,201,975.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,514,182.78	3,201,975.11

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 500 深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）	4,096,241.51	1,123,975.83	5,220,217.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,514,182.78	2,514,182.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,135,905.94	-382,357.78	-1,518,263.72
其中：1. 基金申购款	3,506,247.79	3,964,840.91	7,471,088.70
2. 基金赎回款	-4,642,153.73	-4,347,198.69	-8,989,352.42
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）	2,960,335.57	3,255,800.83	6,216,136.40
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）	52,940,196.69	-1,352,048.85	51,588,147.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,201,975.11	3,201,975.11
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）	-39,756,707.71	-1,738,281.62	-41,494,989.33
其中：1. 基金申购款	68,154,356.06	-1,050,801.88	67,103,554.18
2. 基金赎回款	-107,911,063.77	-687,479.74	-108,598,543.51
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）	13,183,488.98	111,644.64	13,295,133.62

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、会计估计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不含权固定收益品种（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	662,861.91
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	662,861.91

#### 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	5,327,759.99	5,884,305.57	556,545.58
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	5,327,759.99	5,884,305.57	556,545.58

#### 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	119.15
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	0.27
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	0.09

合计	119.51
----	--------

#### 6.4.2.6 其他资产

无。

#### 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	2,373.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,373.80

#### 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
预提费用	288,435.48
合计	338,435.48

#### 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	3,606,145.00	4,096,241.51
本期申购	3,000,000.00	3,407,717.79
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,543,623.73
- 基金拆分/份额折算前	2,606,145.00	2,960,335.57
基金拆分/份额折算变动份额	-98,530.00	
本期末	2,507,615.00	2,960,335.57

#### 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	3,387,593.10	-2,263,617.27	1,123,975.83
本期利润	2,059,041.28	455,141.50	2,514,182.78
本期基金份额交易	-934,416.49	552,058.71	-382,357.78

产生的变动数			
其中：基金申购款	3,336,354.26	628,486.65	3,964,840.91
基金赎回款	-4,270,770.75	-76,427.94	-4,347,198.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,512,217.89	-1,256,417.06	3,255,800.83

#### 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	1,421.53
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	18.45
其他	1.64
合计	1,441.62

#### 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	532,687.07
股票投资收益——赎回差价收入	1,812,878.76
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	2,345,565.83

##### 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	1,649,955.80
减：卖出股票成本总额	1,117,268.73
买卖股票差价收入	532,687.07

##### 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	8,890,822.42
减：现金支付赎回款总额	1,049,459.42
减：赎回股票成本总额	6,028,484.24
赎回差价收入	1,812,878.76

#### 6.4.2.13 债券投资收益

##### 6.4.2.13.1 债券投资收益——赎回差价收入

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

本基金本报告期未投资资产支持证券。

#### 6.4.2.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未投资贵金属。

#### 6.4.2.15 衍生工具收益

本基金本报告期未投资衍生工具。

#### 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	19,504.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,504.81

#### 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	455,141.50
——股票投资	455,141.50
——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	455,141.50
----	------------

#### 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	1,633.87
合计	1,633.87

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	4,332.63
银行间市场交易费用	-
合计	4,332.63

#### 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	75.00
指数使用费	100,000.00
合计	288,510.48

注：指数许可使用基点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，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000.00 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.3.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的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”)	基金管理人的合资子公司

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

本基金本报告期内无与关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.5.1 关联方报酬

###### 6.4.5.1.1 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	13,551.45	53,620.37
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 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.5.1.2 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	2,710.29	10,724.07

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**6.4.5.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.5.3 各关联方投资本基金的情况****6.4.5.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.5.3.2 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.5.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	662,861.91	1,421.53	972,627.05	3,960.23

**6.4.5.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.5.6 其他关联交易事项的说明**

本基金于本报告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

## 6.4.6.1 利润分配情况——非货币市场基金

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

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券

## 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
002183	怡亚通	-	重大事项	73.15	-	-	1,500	63,142.86	109,725.00	-
000748	长城信息	-	重大事项	34.88	-	-	1,600	44,707.35	55,808.00	-
300144	宋城演艺	2015-6-17	重大事项	76.47	2015-7-20	68.82	700	38,510.28	53,529.00	-
002018	华信国际	-	重大事项	44.08	-	-	1,200	23,510.17	52,896.00	-
002223	鱼跃医疗	2015-6-24	重大事项	67.20	2015-7-13	60.48	759	30,733.76	51,004.80	-
002191	劲嘉股份	-	重大事项	19.22	-	-	2,600	31,834.05	49,972.00	-
002308	威创股份	-	重大事项	31.00	-	-	1,500	23,375.32	46,500.00	-
000592	平潭发展	2015-6-29	重大事项	29.76	2015-7-14	30.00	1,500	66,405.00	44,640.00	-
002368	太极股份	-	重大事项	65.52	-	-	660	21,141.15	43,243.20	-
000887	中鼎股份	-	重大事项	24.75	-	-	1,500	35,484.45	37,125.00	-
000982	中银绒业	-	重大事项	4.64	-	-	7,260	34,358.02	33,686.40	-
002309	中利科技	2015-6-1	重大事项	33.39	2015-7-21	30.05	940	24,002.64	31,386.60	-
000697	炼石有色	-	重大事项	33.83	-	-	900	18,516.81	30,447.00	-
300291	华录	2015-6-29	重大		2015-7-13		800	42,354.00	30,208.00	-

	百纳		事项	37.76		41.54				
000066	长城 电脑	-	重大 事项	21.54	-	-	1,400	21,552.69	30,156.00	-
000650	仁和 药业	-	重大 事项	17.17	-	-	1,750	17,042.63	30,047.50	-
002325	洪涛 股份	-	重大 事项	31.15	-	-	887	19,167.19	27,630.05	-
001696	宗申 动力	-	重大 事项	17.25	-	-	1,600	32,741.68	27,600.00	-
000732	泰禾 集团	2015-6-24	重大 事项	34.20	2015-7-2	30.58	800	17,774.38	27,360.00	-
000543	皖能 电力	2015-6-12	重大 事项	21.36	2015-7-14	19.04	1,200	18,474.71	25,632.00	-
000979	中弘 股份	-	重大 事项	6.04	-	-	4,160	16,041.86	25,126.40	-
000788	北大 医药	2015-5-22	重大 事项	20.72	2015-7-21	18.65	1,180	19,445.18	24,449.60	-
002269	美邦 服饰	2015-5-21	重大 事项	11.86	2015-7-2	10.67	2,000	13,952.19	23,720.00	-
002414	高德 红外	-	重大 事项	39.36	-	-	600	16,588.86	23,616.00	-
000786	北新 建材	-	重大 事项	18.58	-	-	1,200	16,340.90	22,296.00	-
002665	首航 节能	2015-6-29	重大 事项	27.70	2015-7-1	30.00	800	21,192.13	22,160.00	-
002106	莱宝 高科	-	重大 事项	16.42	-	-	1,300	18,386.33	21,346.00	-
000959	首钢 股份	-	重大 事项	6.15	-	-	3,400	15,781.79	20,910.00	-
002345	潮宏 基	-	重大 事项	19.58	-	-	1,000	12,049.32	19,580.00	-
002461	珠江 啤酒	2015-6-3	重大 事项	26.40	2015-7-24	23.76	700	12,593.09	18,480.00	-
002091	江苏 国泰	-	重大 事项	26.22	-	-	700	13,614.99	18,354.00	-
000669	金鸿 能源	2015-4-30	重大 事项	37.72	2015-7-23	33.95	450	12,921.82	16,974.00	-
002226	江南 化工	-	重大 事项	13.18	-	-	1,200	11,661.49	15,816.00	-
002727	一心 堂	2015-4-10	重大 事项	78.24	2015-8-17	70.42	200	10,092.23	15,648.00	-
002238	天威 视讯	-	重大 事项	23.76	-	-	650	11,024.40	15,444.00	-

002574	明牌珠宝	-	重大事项	22.90	-	-	618	9,273.31	14,152.20	-
000688	建新矿业	-	重大事项	17.07	-	-	800	9,331.76	13,656.00	-
000850	华茂股份	-	重大事项	10.98	-	-	1,200	9,772.63	13,176.00	-
002203	海亮股份	-	重大事项	12.71	-	-	1,014	9,442.97	12,887.94	-
002143	印纪传媒	2015-6-29	重大事项	32.01	2015-7-1	33.50	400	15,800.00	12,804.00	-
002557	洽洽食品	-	重大事项	16.38	-	-	750	12,105.08	12,285.00	-
002069	獐子岛	-	重大事项	19.76	-	-	600	10,375.47	11,856.00	-
002242	九阳股份	2015-6-12	重大事项	19.45	2015-7-7	17.51	600	9,325.95	11,670.00	-
002194	武汉凡谷	2015-6-17	重大事项	26.98	2015-7-24	24.28	400	6,598.10	10,792.00	-
000519	江南红箭	-	重大事项	26.06	-	-	400	7,663.22	10,424.00	-
000693	华泽钴镍	2015-6-29	重大事项	20.57	2015-8-18	22.63	400	11,727.59	8,228.00	-

#### 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无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 深市指数为原则，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同责任，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 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同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	662,861.91	-	-	-	662,861.91
结算备付金	591.4	-	-	-	591.4
存出保证金	151.24	-	-	-	151.24
交易性金融资产	-	-	-	5,884,305.57	5,884,305.57
应收证券清算款	-	-	-	12,565.97	12,565.97
应收利息	-	-	-	119.51	119.51
资产总计	663,604.55	-	-	5,896,991.05	6,560,595.60

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,041.61	3,041.61
应付托管费	-	-	-	608.31	608.31
应付交易费用	-	-	-	2,373.80	2,373.80
其他负债	-	-	-	338,435.48	338,435.48
负债总计	-	-	-	344,459.20	344,459.20
利率敏感度缺口	663,604.55	-	-	5,552,531.85	6,216,136.40
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	271,826.55	-	-	-	271,826.55
存出保证金	394.87	-	-	-	394.87
交易性金融资产	-	-	-	5,126,061.64	5,126,061.64
应收利息	-	-	-	362.76	362.76
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	272,221.42	-	-	5,126,424.40	5,398,645.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,012.00	3,012.00
应付管理人报酬	-	-	-	3,089.40	3,089.40
应付托管费	-	-	-	617.88	617.88
应付交易费用	-	-	-	1,709.20	1,709.20
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	178,428.48	178,428.48
利率敏感度缺口	272,221.42	-	-	4,947,995.92	5,220,217.34

#### 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。

#### 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	5,884,305.57	94.66	5,126,061.64	98.20
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	5,884,305.57	94.66	5,126,061.64	98.20

#### 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。

金额单位：人民币元

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	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	中证 500 深市指数上升 5%	294,524.00	621,662.16
	中证 500 深市指数下降 5%	-294,524.00	-621,662.16

#### 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	5,884,305.57	89.69
	其中：股票	5,884,305.57	89.69
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	663,453.31	10.11
7	其他各项资产	12,836.72	0.20
8	合计	6,560,595.60	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值，7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 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	176,908.87	2.85
B	采矿业	220,975.70	3.55
C	制造业	3,599,714.58	57.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	140,637.00	2.26
E	建筑业	121,262.05	1.95
F	批发和零售业	245,690.22	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	69,602.00	1.12
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	366,892.28	5.9
J	金融业	14,252.91	0.23
K	房地产业	462,228.56	7.44
L	租赁和商务服务业	247,561.00	3.98
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	46,367.40	0.75
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	33,576.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	121,765.00	1.96
S	综合	16,872.00	0.27
	合计	5,884,305.57	94.66

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	1,500	109,725.00	1.77
2	002405	四维图新	1,300	56,940.00	0.92
3	002030	达安基因	1,260	55,818.00	0.90
4	000748	长城信息	1,600	55,808.00	0.90
5	000566	海南海药	1,100	54,967.00	0.88
6	300144	宋城演艺	700	53,529.00	0.86
7	000540	中天城投	4,200	52,920.00	0.85
8	002018	华信国际	1,200	52,896.00	0.85
9	002223	鱼跃医疗	759	51,004.80	0.82
10	002191	劲嘉股份	2,600	49,972.00	0.80
11	000031	中粮地产	2,600	49,114.00	0.79
12	002022	科华生物	1,100	46,926.00	0.75
13	002308	威创股份	1,500	46,500.00	0.75
14	000592	平潭发展	1,500	44,640.00	0.72
15	002123	荣信股份	2,000	44,500.00	0.72
16	000998	隆平高科	1,638	44,389.80	0.71
17	002368	太极股份	660	43,243.20	0.70
18	300033	同花顺	500	42,995.00	0.69
19	002400	省广股份	1,700	42,942.00	0.69
20	000547	闽福发 A	1,600	42,688.00	0.69
21	300253	卫宁软件	800	41,600.00	0.67
22	000930	中粮生化	2,200	41,470.00	0.67

23	000012	南 玻 A	3,100	41,354.00	0.67
24	000997	新 大 陆	1,526	40,591.60	0.65
25	000511	烯碳新材	3,201	39,212.25	0.63
26	000897	津滨发展	3,900	37,206.00	0.60
27	000887	中鼎股份	1,500	37,125.00	0.60
28	002276	万马股份	1,080	36,882.00	0.59
29	000616	海航投资	3,500	36,330.00	0.58
30	300199	翰宇药业	1,100	35,563.00	0.57
31	002250	联化科技	1,544	34,585.60	0.56
32	300072	三聚环保	1,000	33,700.00	0.54
33	000982	中银绒业	7,260	33,686.40	0.54
34	300244	迪安诊断	400	33,576.00	0.54
35	002701	奥瑞金	1,280	33,318.40	0.54
36	000078	海王生物	1,500	33,000.00	0.53
37	000933	神火股份	3,500	32,970.00	0.53
38	000690	宝新能源	2,600	32,890.00	0.53
39	002266	浙富控股	2,400	32,832.00	0.53
40	002073	软控股份	1,400	32,340.00	0.52
41	300147	香雪制药	1,040	32,032.00	0.52
42	002309	中利科技	940	31,386.60	0.50
43	000671	阳 光 城	1,500	31,170.00	0.50
44	000088	盐 田 港	2,200	31,152.00	0.50
45	002219	恒康医疗	700	31,122.00	0.50
46	300273	和佳股份	1,040	30,981.60	0.50
47	300267	尔康制药	900	30,681.00	0.49
48	002340	格林美	2,003	30,465.63	0.49
49	000697	炼石有色	900	30,447.00	0.49
50	300291	华录百纳	800	30,208.00	0.49
51	000066	长城电脑	1,400	30,156.00	0.49
52	002249	大洋电机	2,348	30,101.36	0.48
53	002358	森源电气	1,400	30,072.00	0.48
54	000650	仁和药业	1,750	30,047.50	0.48
55	002285	世联行	1,400	30,016.00	0.48
56	000758	中色股份	1,500	29,445.00	0.47
57	002489	浙江永强	780	29,406.00	0.47
58	002013	中航机电	1,040	28,964.00	0.47
59	000652	泰达股份	2,839	28,901.02	0.46
60	002049	同方国芯	600	28,800.00	0.46
61	002004	华邦颖泰	2,200	28,556.00	0.46

62	002273	水晶光电	900	28,125.00	0.45
63	002325	洪涛股份	887	27,630.05	0.44
64	001696	宗申动力	1,600	27,600.00	0.44
65	000732	泰禾集团	800	27,360.00	0.44
66	000550	江铃汽车	741	27,194.70	0.44
67	000006	深振业 A	2,000	27,140.00	0.44
68	000667	美好集团	4,000	26,880.00	0.43
69	002221	东华能源	900	26,847.00	0.43
70	000513	丽珠集团	395	26,792.85	0.43
71	000848	承德露露	1,472	26,790.40	0.43
72	000415	渤海租赁	2,800	26,488.00	0.43
73	000685	中山公用	900	26,487.00	0.43
74	002440	闰土股份	1,100	26,367.00	0.42
75	002179	中航光电	793	26,169.00	0.42
76	002161	远望谷	1,200	26,112.00	0.42
77	000661	长春高新	200	26,000.00	0.42
78	000718	苏宁环球	1,800	25,974.00	0.42
79	002063	远光软件	824	25,766.48	0.41
80	002271	东方雨虹	1,000	25,700.00	0.41
81	000543	皖能电力	1,200	25,632.00	0.41
82	002317	众生药业	900	25,371.00	0.41
83	002005	德豪润达	2,200	25,256.00	0.41
84	002573	清新环境	1,220	25,217.40	0.41
85	000572	海马汽车	3,000	25,170.00	0.40
86	000979	中弘股份	4,160	25,126.40	0.40
87	002424	贵州百灵	400	25,024.00	0.40
88	002195	二三四五	600	24,936.00	0.40
89	000988	华工科技	1,400	24,934.00	0.40
90	000656	金科股份	3,600	24,876.00	0.40
91	000816	智慧农业	2,400	24,816.00	0.40
92	300088	长信科技	900	24,750.00	0.40
93	002466	天齐锂业	400	24,720.00	0.40
94	000681	视觉中国	600	24,636.00	0.40
95	300274	阳光电源	800	24,456.00	0.39
96	000788	北大医药	1,180	24,449.60	0.39
97	002025	航天电器	910	23,842.00	0.38
98	002269	美邦服饰	2,000	23,720.00	0.38
99	000939	凯迪电力	1,617	23,689.05	0.38
100	002414	高德红外	600	23,616.00	0.38

101	002428	云南锆业	1,002	23,557.02	0.38
102	002508	老板电器	600	23,016.00	0.37
103	002642	荣之联	400	22,860.00	0.37
104	000062	深圳华强	400	22,828.00	0.37
105	002396	星网锐捷	700	22,470.00	0.36
106	000975	银泰资源	1,302	22,433.46	0.36
107	002092	中泰化学	2,200	22,418.00	0.36
108	000028	国药一致	300	22,353.00	0.36
109	000786	北新建材	1,200	22,296.00	0.36
110	002056	横店东磁	710	22,208.80	0.36
111	002665	首航节能	800	22,160.00	0.36
112	002244	滨江集团	1,200	22,092.00	0.36
113	000830	鲁西化工	2,200	21,912.00	0.35
114	000829	天音控股	1,472	21,859.20	0.35
115	002050	三花股份	1,900	21,831.00	0.35
116	002595	豪迈科技	1,000	21,580.00	0.35
117	000969	安泰科技	1,500	21,570.00	0.35
118	002028	思源电气	1,171	21,546.40	0.35
119	002390	信邦制药	1,200	21,456.00	0.35
120	000021	深科技	1,400	21,350.00	0.34
121	002106	莱宝高科	1,300	21,346.00	0.34
122	002672	东江环保	1,000	21,150.00	0.34
123	002029	七匹狼	1,000	21,000.00	0.34
124	000959	首钢股份	3,400	20,910.00	0.34
125	000762	西藏矿业	1,100	20,900.00	0.34
126	002048	宁波华翔	1,000	20,790.00	0.33
127	002190	成飞集成	400	20,396.00	0.33
128	002437	誉衡药业	700	20,335.00	0.33
129	002444	巨星科技	1,100	20,328.00	0.33
130	002299	圣农发展	1,000	20,300.00	0.33
131	002168	深圳惠程	1,300	20,176.00	0.32
132	300115	长盈精密	600	19,986.00	0.32
133	002155	湖南黄金	1,600	19,888.00	0.32
134	000777	中核科技	600	19,710.00	0.32
135	002345	潮宏基	1,000	19,580.00	0.31
136	000090	天健集团	800	19,400.00	0.31
137	002311	海大集团	1,400	19,306.00	0.31
138	000973	佛塑科技	1,600	19,200.00	0.31
139	002477	雏鹰农牧	1,000	19,200.00	0.31

140	002315	焦点科技	200	19,200.00	0.31
141	002064	华峰氨纶	2,100	19,047.00	0.31
142	300134	大富科技	680	19,006.00	0.31
143	000528	柳工	1,600	18,912.00	0.30
144	002277	友阿股份	1,100	18,876.00	0.30
145	000735	罗牛山	2,000	18,780.00	0.30
146	000501	鄂武商 A	906	18,573.00	0.30
147	002174	游族网络	200	18,552.00	0.30
148	000587	金叶珠宝	800	18,504.00	0.30
149	002408	齐翔腾达	1,079	18,494.06	0.30
150	002461	珠江啤酒	700	18,480.00	0.30
151	000422	湖北宜化	2,000	18,460.00	0.30
152	000417	合肥百货	1,500	18,375.00	0.30
153	002091	江苏国泰	700	18,354.00	0.30
154	000926	福星股份	1,296	18,286.56	0.29
155	300043	互动娱乐	1,200	18,012.00	0.29
156	000488	晨鸣纸业	2,000	17,940.00	0.29
157	000612	焦作万方	1,640	17,908.80	0.29
158	000541	佛山照明	1,560	17,893.20	0.29
159	000860	顺鑫农业	780	17,869.80	0.29
160	000099	中信海直	1,000	17,780.00	0.29
161	002041	登海种业	1,003	17,743.07	0.29
162	000680	山推股份	2,000	17,740.00	0.29
163	002122	天马股份	1,663	17,710.95	0.28
164	000620	新华联	1,300	17,706.00	0.28
165	002384	东山精密	800	17,688.00	0.28
166	002431	棕榈园林	600	17,412.00	0.28
167	002551	尚荣医疗	400	17,356.00	0.28
168	002373	千方科技	400	17,316.00	0.28
169	000525	红太阳	772	17,269.64	0.28
170	000861	海印股份	800	17,192.00	0.28
171	000401	冀东水泥	1,300	17,095.00	0.28
172	000669	金鸿能源	450	16,974.00	0.27
173	000877	天山股份	1,440	16,876.80	0.27
174	000931	中关村	1,200	16,872.00	0.27
175	000418	小天鹅 A	700	16,730.00	0.27
176	002503	搜于特	880	16,614.40	0.27
177	000900	现代投资	1,600	16,416.00	0.26
178	002482	广田股份	600	16,380.00	0.26

179	002293	罗莱家纺	900	16,281.00	0.26
180	300039	上海凯宝	1,040	16,172.00	0.26
181	300202	聚龙股份	400	16,160.00	0.26
182	002251	步步高	660	16,104.00	0.26
183	002093	国脉科技	1,000	16,000.00	0.26
184	002078	太阳纸业	2,000	16,000.00	0.26
185	000961	中南建设	800	15,976.00	0.26
186	002226	江南化工	1,200	15,816.00	0.25
187	002463	沪电股份	1,878	15,681.30	0.25
188	002727	一心堂	200	15,648.00	0.25
189	002181	粤传媒	1,060	15,582.00	0.25
190	002663	普邦园林	1,600	15,520.00	0.25
191	002238	天威视讯	650	15,444.00	0.25
192	002371	七星电子	400	15,200.00	0.24
193	000636	风华高科	1,200	14,976.00	0.24
194	000603	盛达矿业	600	14,964.00	0.24
195	002332	仙琚制药	850	14,722.00	0.24
196	002479	富春环保	800	14,680.00	0.24
197	000600	建投能源	1,000	14,680.00	0.24
198	000869	张裕 A	300	14,637.00	0.24
199	002011	盾安环境	1,000	14,490.00	0.23
200	002281	光迅科技	300	14,424.00	0.23
201	002237	恒邦股份	1,200	14,364.00	0.23
202	000049	德赛电池	300	14,310.00	0.23
203	000563	陕国投 A	1,013	14,252.91	0.23
204	002574	明牌珠宝	618	14,152.20	0.23
205	000726	鲁泰 A	1,000	13,900.00	0.22
206	002233	塔牌集团	800	13,808.00	0.22
207	000688	建新矿业	800	13,656.00	0.22
208	000852	江钻股份	400	13,540.00	0.22
209	000719	大地传媒	600	13,392.00	0.22
210	002480	新筑股份	822	13,365.72	0.22
211	000919	金陵药业	686	13,363.28	0.21
212	002342	巨力索具	1,400	13,258.00	0.21
213	002128	露天煤业	800	13,184.00	0.21
214	000850	华茂股份	1,200	13,176.00	0.21
215	002203	海亮股份	1,014	12,887.94	0.21
216	002254	泰和新材	800	12,880.00	0.21
217	002143	印纪传媒	400	12,804.00	0.21

218	000030	富奥股份	1,100	12,727.00	0.20
219	002681	奋达科技	460	12,631.60	0.20
220	002216	三全食品	852	12,524.40	0.20
221	002557	洽洽食品	750	12,285.00	0.20
222	002275	桂林三金	480	12,268.80	0.20
223	002327	富安娜	964	11,895.76	0.19
224	002069	獐子岛	600	11,856.00	0.19
225	002646	青青稞酒	400	11,672.00	0.19
226	002242	九阳股份	600	11,670.00	0.19
227	002204	大连重工	872	11,649.92	0.19
228	000951	中国重汽	400	11,528.00	0.19
229	002588	史丹利	400	11,500.00	0.19
230	000823	超声电子	851	11,454.46	0.18
231	000426	兴业矿业	669	11,045.19	0.18
232	002194	武汉凡谷	400	10,792.00	0.17
233	002698	博实股份	200	10,560.00	0.17
234	000519	江南红箭	400	10,424.00	0.17
235	002118	紫鑫药业	600	10,380.00	0.17
236	002392	北京利尔	1,200	10,368.00	0.17
237	000703	恒逸石化	800	10,208.00	0.16
238	000631	顺发恒业	1,240	10,031.60	0.16
239	000921	海信科龙	800	9,760.00	0.16
240	002635	安洁科技	400	9,740.00	0.16
241	000596	古井贡酒	200	9,336.00	0.15
242	002267	陕天然气	600	9,294.00	0.15
243	002393	力生制药	200	9,136.00	0.15
244	002140	东华科技	400	8,944.00	0.14
245	000962	东方钽业	600	8,880.00	0.14
246	000693	华泽钴镍	400	8,228.00	0.13
247	002240	威华股份	600	8,136.00	0.13
248	002678	珠江钢琴	400	8,112.00	0.13
249	002430	杭氧股份	600	7,932.00	0.13
250	002225	濮耐股份	800	7,568.00	0.12
251	000780	平庄能源	800	7,456.00	0.12
252	002490	山东墨龙	600	7,206.00	0.12
253	002662	京威股份	400	7,136.00	0.11
254	002419	天虹商场	400	6,800.00	0.11
255	002648	卫星石化	426	6,449.64	0.10
256	000552	靖远煤电	400	5,640.00	0.09

257	000582	北部湾港	200	4,254.00	0.07
258	002705	新宝股份	200	3,760.00	0.06

### 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

无。

### 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	000592	平潭发展	66,405.00	1.27
2	002400	省广股份	58,648.00	1.12
3	300033	同花顺	57,950.00	1.11
4	300199	翰宇药业	55,495.00	1.06
5	000547	闽福发 A	52,816.00	1.01
6	300244	迪安诊断	49,002.00	0.94
7	300291	华录百纳	42,354.00	0.81
8	300072	三聚环保	39,980.00	0.77
9	002195	二三四五	37,632.00	0.72
10	002466	天齐锂业	36,904.00	0.71
11	300267	尔康制药	36,855.00	0.71
12	300274	阳光电源	36,432.00	0.70
13	002049	同方国芯	34,284.00	0.66
14	002642	荣之联	33,897.00	0.65
15	002373	千方科技	28,640.00	0.55
16	002190	成飞集成	27,816.00	0.53
17	300043	互动娱乐	25,584.00	0.49
18	000401	冀东水泥	25,350.00	0.49
19	002681	奋达科技	21,308.00	0.41
20	002013	中航机电	17,980.00	0.34

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

#### 7.4.2 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	300059	东方财富	218,610.00	4.19
2	300168	万达信息	116,816.00	2.24
3	000712	锦龙股份	84,151.00	1.61
4	000977	浪潮信息	81,720.00	1.57
5	000627	天茂集团	53,256.00	1.02
6	002690	美亚光电	47,923.80	0.92
7	000050	深天马 A	42,228.00	0.81
8	000506	中润资源	41,440.00	0.79
9	002612	朗姿股份	39,585.24	0.76
10	300253	卫宁软件	38,151.00	0.73
11	002050	三花股份	33,852.20	0.65
12	000616	海航投资	31,768.00	0.61
13	000028	国药一致	26,973.80	0.52
14	002018	华信国际	26,448.00	0.51
15	002052	同洲电子	24,213.00	0.46
16	000997	新大陆	24,016.00	0.46
17	002505	大康牧业	22,971.00	0.44
18	000540	中天城投	22,412.00	0.43
19	002437	誉衡药业	22,112.50	0.42
20	002396	星网锐捷	21,385.00	0.41

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	1,032,510.00
卖出股票收入（成交）总额	1,649,955.80

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**

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，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	151.24
2	应收证券清算款	12,565.97
3	应收股利	-
4	应收利息	119.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,836.72

#### 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	002183	怡亚通	109,725.00	1.77	重大事项
2	000748	长城信息	55,808.00	0.90	重大事项
3	000566	海南海药	54,967.00	0.88	重大事项
4	300144	宋城演艺	53,529.00	0.86	重大事项
5	002018	华信国际	52,896.00	0.85	重大事项
6	002223	鱼跃医疗	51,004.80	0.82	重大事项
7	002191	劲嘉股份	49,972.00	0.80	重大事项

##### 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

无。

#### 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
244	10,277.11	21,466.00	0.86%	2,486,149.00	99.14%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 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	赵基钿	163,105.00	6.50%
2	邢秋珍	154,535.00	6.16%
3	黄连财	101,666.00	4.05%
4	苏秀兰	84,729.00	3.38%
5	王捷飞	84,728.00	3.38%
6	王水英	77,725.00	3.10%
7	邹璞如	71,824.00	2.86%
8	张路遥	61,583.00	2.46%
9	罗昭义	59,301.00	2.36%
10	肖卫中	57,942.00	2.31%

## 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	0.00	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、基金投资和相关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（2013年9月12日）基金份额总额	333,508,962.00
本报告期期初基金份额总额	3,606,145.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-98,530.00
本报告期末基金份额总额	2,507,615.00

## § 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

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	
申银万国	1	2,682,465.80	100.00%	2,373.80	100.00%	-
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%	-
招商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	1	-	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%	-
光大证券	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%	-
海通证券	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%	-
华泰证券	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%	-
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 1 个。本报告期内本基金退租席位：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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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	大成中证 500 深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
15	大成中证 500 深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	2015-4-24
16	大成中证 500 深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	2015-4-24
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
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	大成中证 500 深市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
23	关于大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告 (1)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015-6-19
24	关于大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告 (2)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015-6-24
25	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
26	关于大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算比例及暂停交易和申购、赎回的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015-6-29
27	关于大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算结果及恢复交易和申购、赎回的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015-6-30

### § 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大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 500 深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