

大成深证成份交易型  
开放式指数证券投资基金  
2015 年年度报告  
2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 月 26 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 2016 年 3 月 24 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 6 月 5 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	18
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53
8.8 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.....	54
8.9 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.....	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
8.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
9.4 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.....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
11.2 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.....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录.....	64
13.2 存放地点.....	65
13.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成深证 ETF
场内简称	深证 ETF
基金主代码	159943
交易代码	159943
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	58,135,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-07-08

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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》
登载基金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 中国农业银行托管业务部

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-406,999,068.76
本期利润	-393,853,788.97
加权平均基金份额本期利润	-1.1359
本期加权平均净值利润率	-32.31%
本期基金份额净值增长率	-13.75%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-220,806,172.35
期末可供分配基金份额利润	-3.7981
期末基金资产净值	763,719,894.04
期末基金份额净值	13.137
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-13.75%

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）。

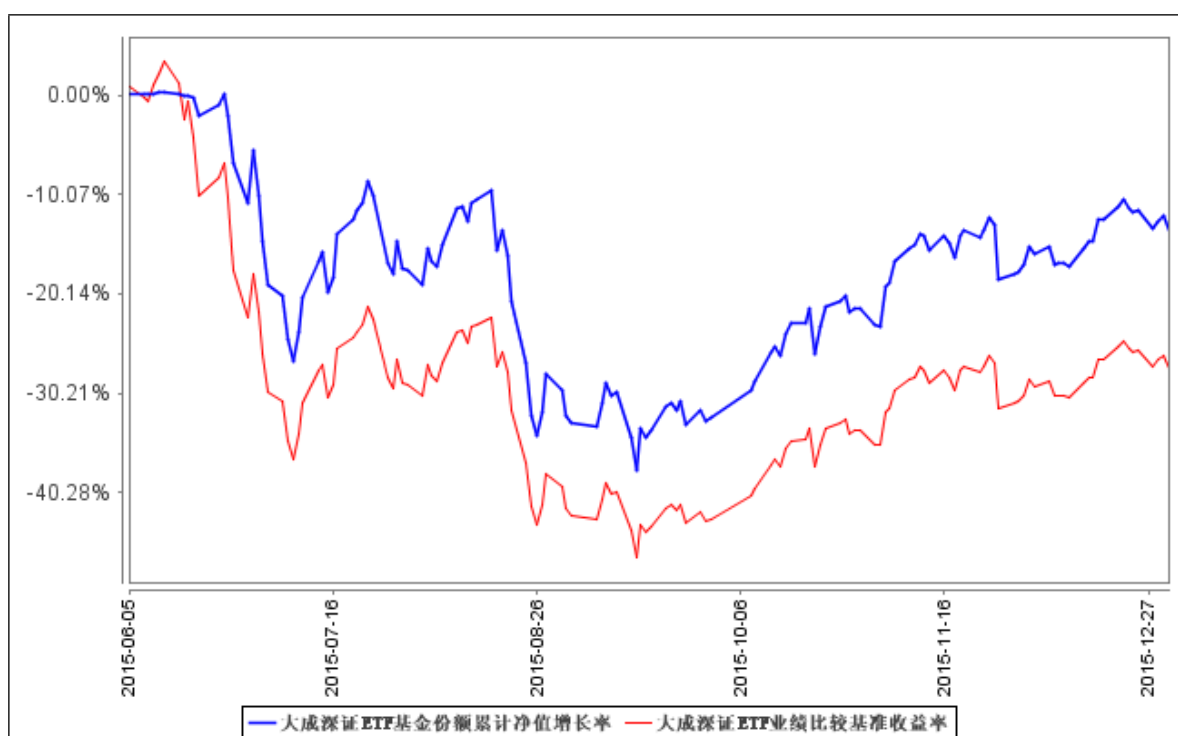
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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
过去三个月	28.12%	2.03%	26.80%	2.03%	1.32%	0.00%
过去六个月	-8.60%	2.98%	-11.67%	2.96%	3.07%	0.02%
自基金合同生效起至今	-13.75%	2.90%	-27.63%	3.06%	13.88%	-0.16%

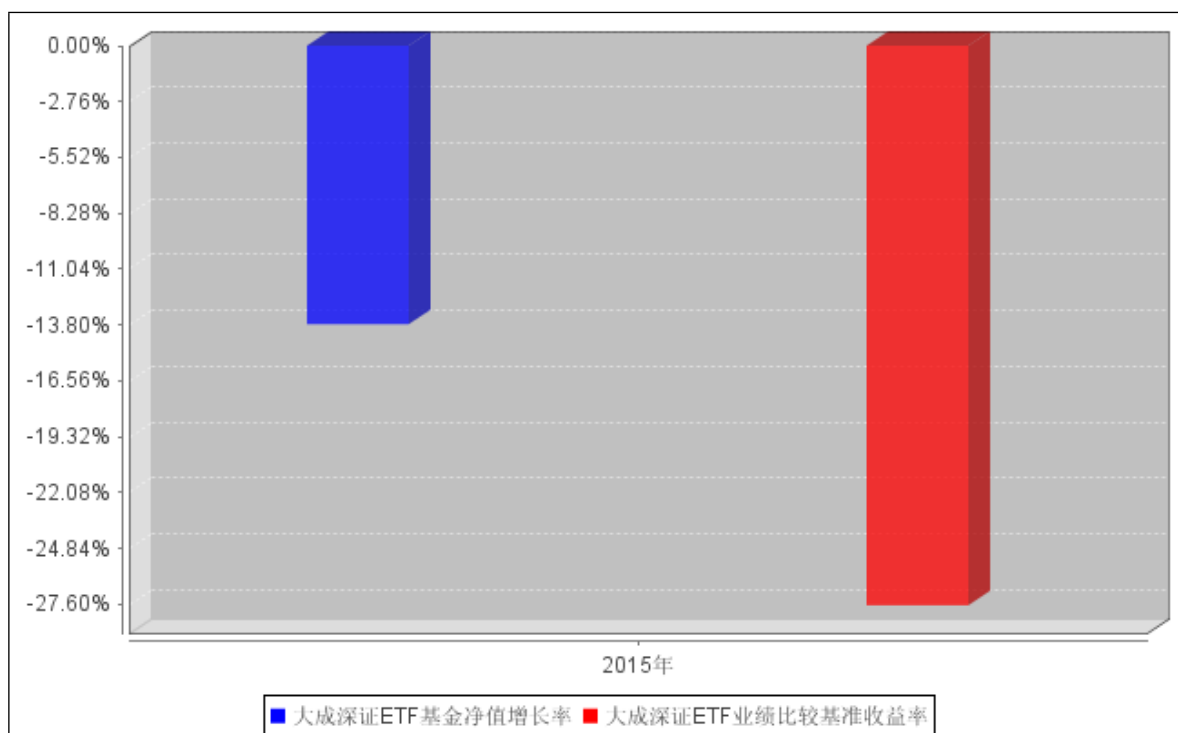
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 5 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015 年净值增长率表现期间为 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 12 月 31 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 55 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、大成景源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、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理 数量与指数投资部副	2015 年 6 月 5 日	-	12 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市

	总监				交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 5 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国
杨台山先生	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	7 年	经济学硕士，中国注册会计师。2008 年 1 月至 2008 年 12 月先后任职于中国平安保险（集团）股份有限公司集团资金管理部、集团财务部，从事投资财务工作。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部基金会计师、基金运营部基金核算中心主管、数量投资部数量分析师，现任数量与指数投资部高级数量分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月 20 日起，担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金和大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、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遵规守信情况的说明

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》、《大成深证成份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，大成深证成份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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 130 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，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；主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年宏观经济依然乏善可陈。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，而且也造成了一些乱象。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。尽管货币政策和财政政策频频进行刺激，但在根本性问题未解决的情况下，信用收缩周期难以结束。外围形势也不容乐观，大宗商品价格萎靡，外需不振。人民币开始贬值，虽然对出口有利，但也形成了较大的资本外流压力。

和宏观经济持续筑底不同，证券市场在 2015 年却经历了巨大的波动。先是依托货币政策放松、央行行长表态“资金进股市也是支持实体经济”等因素支持，资金脱实向虚，延续 2014 年的疯牛，继续强势攀升并且泡沫化日趋严重；然后在监管部门的努力下，上述情况出现反转，从 6 月开始了惨烈的去杠杆行情，即使在暴跌后间或反弹，下半年总体还是比较惨淡。

纵观全年，市场基准沪深 300 指数仅上涨 5.58%。几乎所有股票都经历了同样的大起大落，但成长风格还是明显领先，中小板和创业板分别上涨 53.70%和 84.41%，大幅跑赢大盘。行业之间差异更为明显，新兴行业优势巨大。计算机行业涨幅超过一倍，电子、通信、传媒、轻工制造、休闲服务等行业也涨幅靠前；反观金融、煤炭、钢铁等传统行业则表现不佳，甚至不涨反跌。

本基金成立于 2015 年 6 月 5 日，之后不久便遭遇股市系统性风险。基于 ETF 产品实物申购赎回的特性，本基金上市交易时必须持有较高的仓位，且在上市交易和开放申购赎回后基本保持满仓运作，以紧密跟踪标的指数。基金管理人谨慎控制建仓节奏，在一定程度上避免了损失。自上市日起至年末，年化跟踪误差 1.39%，日均偏离度 0.06%，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 13.137 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.75%，同期业绩比较基准收益率为-27.63%，高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

宏观经济低迷已久，“供给侧”已然取代“新常态”，成为政府新的药方。药方是否有效，如何起效，还需要较长的时间来检验，短期内经济复苏的可能性不大。同时，从“供给侧”着手，说明施行强刺激政策的可能性有所降低。

值得注意的是，人民币汇率的演变可能会造成一系列深远的影响。在当前形势下，无论是产

业资本、投机资金、居民储蓄，都有加大海外配置的动力，人民币贬值压力较大。改革的推进需要有独立的货币政策保驾护航，货币政策在蒙代尔三角中地位相对稳固。若资本持续外流，外汇储备告急，政府将不得不从外汇管制和货币贬值中两害相权取其轻。而无论哪个选项，对资本市场都不能算是好消息。

展望明年股市，有可能是危中有机、宽幅振荡的格局。宏观经济复苏遥遥无期，而经过上一波“资金牛”的洗礼后，监管部门政策取向也会趋于谨慎，短期内再次主动刺激泡沫的可能性微乎其微。基本面、政策面都并不支持大牛市的重演。

另一方面，从资金面来看，在央行的努力下，社会总体流动性较为充裕，稳健低风险回报尚可的资产所剩无几，形成所谓的“资产荒”。货币宽松的大环境将对股市构成最有力的支撑。尽管没有系统性的机会，阶段性的风险偏好改善也会导致资金流入股市，带来波段行情。而股灾之后，市场微观结构已经发生了较大的变化，股价波动明显加剧，故阶段性反弹行情也将会有较为可观的涨幅。

本基金已完成建仓并正常上市交易、开放申购赎回。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续

对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 6 月 5 日至 2015 年 12 月 31 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 审计报告

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“大成深证 ETF”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是大成深证 ETF 的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。  审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述大成深证 ETF 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了大成深证 ETF 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛 竞	俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金



报告截止日： 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	9,661,424.60
结算备付金		298,257.90
存出保证金		1,440,150.78
交易性金融资产	7.4.7.2	758,516,505.19
其中：股票投资		758,386,105.19
基金投资		-
债券投资		130,400.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,555.62
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		769,918,894.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		5,394,328.46
应付赎回款		-
应付管理人报酬		354,600.55
应付托管费		70,920.09
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	157,394.73
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	221,756.22
负债合计		6,199,000.05
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	7.4.7.9	885,607,308.57
未分配利润	7.4.7.10	-121,887,414.53
所有者权益合计		763,719,894.04
负债和所有者权益总计		769,918,894.09

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 13.137 元，基金份额总额 58,135,342.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间，截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-386,659,073.14
1. 利息收入		2,147,400.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,087,368.94
债券利息收入		20.01
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,060,011.73
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-400,966,002.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-406,100,608.14
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	5,134,605.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,145,279.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-985,750.80
<b>减：二、费用</b>		7,194,715.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2 .1	3,455,301.43
2. 托管费	7.4.10.2 .2	691,060.24
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	7.4.7.19	2,574,551.06
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	473,803.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-393,853,788.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-393,853,788.97

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31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）	2,384,588,069.00	-	2,384,588,069.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-393,853,788.97	-393,853,788.97
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）	-1,498,980,760.43	271,966,374.44	-1,227,014,385.99
其中：1. 基金申购款	4,455,811,711.41	-721,201,411.80	3,734,610,299.61
2. 基金赎回款	-5,954,792,471.84	993,167,786.24	-4,961,624,685.60
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）	885,607,308.57	-121,887,414.53	763,719,894.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

    
 罗登攀                                    周立新                                    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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委

员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]450号《关于核准大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,384,454,750.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第 634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,384,588,069.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 133,319.00 元份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]330 号文审核同意,本基金于 2015 年 7 月 8 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求与标的指数相似的投资回报;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;本基金可少量投资于债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下,本基金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%。本基金的业绩比较基准为:深证成份指数。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 5 日

(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利

终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算

的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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



## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	9,661,424.60
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	9,661,424.60

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	745,240,825.40	758,386,105.19	13,145,279.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	130,400.00	130,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	130,400.00	130,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	745,371,225.40	758,516,505.19	13,145,279.79

## 7.4.7.3 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。

## 7.4.7.4 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。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,719.83
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	167.68

应收债券利息	20.01
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	648.10
合计	2,555.62

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	157,394.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	157,394.73

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付指数使用费	66,756.22
预提费用	155,000.00
合计	221,756.22

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,384,588,069.00	2,384,588,069.00
2015年6月29日 基金拆分/份额 折算前	2,384,588,069.00	2,384,588,069.00
基金拆分/份额折算变动份额	-2,228,052,727.00	-
本期申购	292,500,000.00	4,455,811,711.41
本期赎回(以“-”号填列)	-390,900,000.00	-5,954,792,471.84
本期末	58,135,342.00	885,607,308.57

注：1. 本基金自2015年5月11日起至2015年5月29日止期间公开发售，共募集有效净认购资本2,384,454,750.00元(含网下股票对应的募集资金)。根据《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》

的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 133,319.00 元在本基金成立后，折算为 133,319.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》的规定，以及《关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金的基金管理人大成基金 确定 2015 年 6 月 29 日为本基金的基金份额折算基准日。当日基金资产净值为 2,123,815,873.03 元，折算前基金份额总额为 2,384,588,069.00 份，折算前基金份额净值为 0.891 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.06565125，折算后基金份额总额为 156,535,342.00 份，折算后基金份额净值为 13.568 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2015 年 6 月 30 日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-406,999,068.76	13,145,279.79	-393,853,788.97
本期基金份额交易产生的变动数	186,192,896.41	85,773,478.03	271,966,374.44
其中：基金申购款	-728,857,389.22	7,655,977.42	-721,201,411.80
基金赎回款	915,050,285.63	78,117,500.61	993,167,786.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-220,806,172.35	98,918,757.82	-121,887,414.53

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,009,548.54
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	70,927.13
其他	6,893.27
合计	1,087,368.94

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
----	---

股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,955,723.58
股票投资收益——赎回差价收入	-397,144,884.56
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-406,100,608.14

#### 7.4.7.12.2 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6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	134,718,670.70
减：卖出股票成本总额	143,674,394.28
买卖股票差价收入	-8,955,723.58

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
赎回基金份额对价总额	4,961,624,685.60
减：现金支付赎回款总额	826,398,016.60
减：赎回股票成本总额	4,532,371,553.56
赎回差价收入	-397,144,884.56

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,134,605.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,134,605.33

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	13,145,279.79
——股票投资	13,145,279.79
——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	13,145,279.79

## 7.4.7.18 其他收入

项目	本期
	2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
替代损益收入	-985,750.80
合计	-985,750.80

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。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,574,551.06
银行间市场交易费用	-
合计	2,574,551.06

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	105,000.00
信息披露费	100,000.00
指数使用费	207,318.10
上市年费	60,000.00

银行划款手续费	985.00
其他	500.00
合计	473,803.10

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	319,171,958.08	13.05%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 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6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31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	288,570.36	13.29%	157,394.73	100.00%

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,455,301.43
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	691,060.24

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.10.5 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6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	9,661,424.60	1,009,548.54

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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 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。

**7.4.12 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-1-8	未上市	100.00	100.00	1,304	130,400.00	130,400.00	-



## 7.4.12.2 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
000002	万科 A	2015-12-18	重大事项	24.43			1,187,500	16,867,158.87	29,010,625.00	-
000028	国药一致	2015-10-21	重大事项	66.15			19,900	1,421,852.86	1,316,385.00	-
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	21.54	2016-03-10	19.39	7,900	168,437.00	170,166.00	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项	7.06	2016-03-21	7.77	103,100	886,000.16	727,886.00	-
000553	沙隆达 A	2015-08-05	重大事项	10.70			43,500	560,683.46	465,450.00	-
000712	锦龙股份	2015-12-25	重大事项	29.12	2016-01-04	28.00	65,700	2,619,989.09	1,913,184.00	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	34.88	2016-03-10	31.39	7,700	279,344.00	268,576.00	-
000767	漳泽电力	2015-12-30	重大事项	5.77	2016-01-04	6.10	122,300	886,791.05	705,671.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项	12.22			95,100	1,263,050.32	1,162,122.00	-
000876	新希望	2015-08-17	重大事项	18.99	2016-03-02	17.09	154,500	2,954,020.69	2,933,955.00	-
000901	航天科技	2015-08-19	重大事项	52.88	2016-02-18	47.59	35,900	2,091,899.48	1,898,392.00	-
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项	13.00	2016-02-22	11.70	107,100	989,564.12	1,392,300.00	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项	16.72	2016-02-22	15.05	64,700	911,538.58	1,081,784.00	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项	44.08			5,900	223,967.00	260,072.00	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项	17.40			59,900	1,029,091.77	1,042,260.00	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项	60.15	2016-03-11	54.14	34,700	1,467,651.25	2,087,205.00	-
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项	25.10			112,000	2,842,929.92	2,811,200.00	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事项	89.53	2016-02-15	80.58	11,300	1,157,970.17	1,011,689.00	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大事项	14.90			152,177	2,459,730.96	2,267,437.30	-
002235	安妮股份	2015-07-02	重大事项	29.10	2016-01-12	32.00	16,200	508,506.89	471,420.00	-
002240	威华股份	2015-12-25	重大事项	13.68	2016-01-22	12.31	39,300	597,784.00	537,624.00	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	34,900	930,379.81	791,532.00	-
002313	日海通讯	2015-08-10	重大事项	14.80	2016-01-22	13.90	35,500	558,934.35	525,400.00	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事项	15.20	2016-01-06	14.35	135,500	1,869,875.42	2,059,600.00	-
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	188,400	3,147,711.68	3,144,396.00	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大事项	29.65			41,823	1,478,639.53	1,240,051.95	-
002638	勤上光电	2015-08-31	重大事项	15.32	2016-01-19	16.85	39,000	655,833.72	597,480.00	-
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项	29.33	2016-01-05	26.40	24,990	666,273.13	732,956.70	-
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项	31.90	2016-01-08	28.71	45,961	1,184,040.51	1,466,155.90	-
300011	鼎汉技术	2015-12-31	重大事项	29.80	2016-01-22	26.82	28,300	973,171.71	843,340.00	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80			75,700	1,175,918.95	1,196,060.00	-
300054	鼎龙股份	2015-11-23	重大事项	24.66	2016-03-14	22.19	40,900	777,544.53	1,008,594.00	-
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项	14.03	2016-02-29	12.63	115,600	1,318,007.63	1,621,868.00	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项	58.80			141,000	6,443,913.05	8,290,800.00	-
300197	铁汉生态	2015-12-30	重大事项	17.11	2016-01-07	16.59	39,800	790,581.40	680,978.00	-
300238	冠昊生物	2015-11-12	重大事项	56.67			28,100	1,009,644.67	1,592,427.00	-

300324	旋极信息	2015-12-01	重大事项	49.25	2016-03-10	44.33	32,400	919,245.47	1,595,700.00	-
300336	新文化	2015-12-24	重大事项	42.00			22,330	553,555.10	937,860.00	-
300355	蒙草抗旱	2015-12-14	重大事项	17.84	2016-02-16	16.06	33,400	532,733.66	595,856.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净值的比例为 0.02%。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还

面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	9,661,424.60	-	-	-	9,661,424.60
结算备付金	298,257.90	-	-	-	298,257.90
存出保证金	1,440,150.78	-	-	-	1,440,150.78
交易性金融资产	-	-130,400.00	758,386,105.19	758,516,505.19	758,516,505.19
应收利息	-	-	-	2,555.62	2,555.62
<b>资产总计</b>	<b>11,399,833.28</b>	<b>-</b>	<b>130,400.00</b>	<b>758,388,660.81</b>	<b>769,918,894.09</b>
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,394,328.46	5,394,328.46
应付管理人报酬	-	-	-	354,600.55	354,600.55
应付托管费	-	-	-	70,920.09	70,920.09
应付交易费用	-	-	-	157,394.73	157,394.73
其他负债	-	-	-	221,756.22	221,756.22
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,199,000.05</b>	<b>6,199,000.05</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>11,399,833.28</b>	<b>-130,400.00</b>	<b>752,189,660.76</b>	<b>763,719,894.04</b>	

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	758,386,105.19	99.30
交易性金融资产—基金投资	—	0.00
交易性金融资产—债券投资	—	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	0.00
其他	—	0.00
合计	758,386,105.19	99.30

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	35,020,000.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-35,020,000.00	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的

对价总额为 3,734,610,299.61 元，其中包括以股票支付的申购款 3,033,722,558.00 元和以现金支付的申购款 700,887,741.61 元。

## (2) 公允价值

### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

#### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 675,929,646.34 元，属于第二层次的余额为 82,586,858.85 元，无第三层次的余额。

#### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	758,386,105.19	98.50
	其中：股票	758,386,105.19	98.50
2	固定收益投资	130,400.00	0.02
	其中：债券	130,400.00	0.02
	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	9,959,682.50	1.29
7	其他各项资产	1,442,706.40	0.19
8	合计	769,918,894.09	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	9,672,277.80	1.27
B	采矿业	11,824,302.52	1.55
C	制造业	424,828,291.42	55.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,240,575.55	1.86
E	建筑业	13,213,930.26	1.73
F	批发和零售业	22,457,083.28	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	3,631,991.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,522,599.79	12.51
J	金融业	48,817,091.60	6.39
K	房地产业	60,255,173.57	7.89
L	租赁和商务服务业	17,203,366.65	2.25
M	科学研究和技术服务业	1,534,669.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	12,317,007.86	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	3,582,114.54	0.47
R	文化、体育和娱乐业	15,611,764.35	2.04
S	综合	3,673,866.00	0.48
	合计	758,386,105.19	99.30

## 8.3 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

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	000002	万科A	1,187,500	29,010,625.00	3.80
2	000651	格力电器	560,700	12,531,645.00	1.64
3	000001	平安银行	776,800	9,313,832.00	1.22
4	000725	京东方A	2,904,000	8,624,880.00	1.13
5	300104	乐视网	141,000	8,290,800.00	1.09
6	000333	美的集团	252,500	8,287,050.00	1.09
7	300059	东方财富	138,000	7,180,140.00	0.94
8	000776	广发证券	357,200	6,947,540.00	0.91
9	002024	苏宁云商	512,300	6,890,435.00	0.90
10	000858	五粮液	217,600	5,936,128.00	0.78
11	002450	康得新	151,698	5,779,693.80	0.76
12	002415	海康威视	155,100	5,333,889.00	0.70
13	001979	招商蛇口	247,901	5,171,214.86	0.68
14	000063	中兴通讯	273,100	5,087,853.00	0.67
15	000783	长江证券	397,900	4,941,918.00	0.65
16	000100	TCL 集团	1,045,900	4,455,534.00	0.58
17	002202	金风科技	193,700	4,414,423.00	0.58
18	000166	申万宏源	408,700	4,377,177.00	0.57
19	000625	长安汽车	252,788	4,289,812.36	0.56
20	002594	比亚迪	64,600	4,160,240.00	0.54
21	300024	机器人	59,330	4,064,105.00	0.53
22	002673	西部证券	123,300	4,057,803.00	0.53
23	300027	华谊兄弟	93,900	3,894,972.00	0.51
24	002230	科大讯飞	103,750	3,843,937.50	0.50
25	002183	怡亚通	80,900	3,726,254.00	0.49
26	000917	电广传媒	138,300	3,673,248.00	0.48
27	300070	碧水源	70,800	3,665,316.00	0.48
28	000538	云南白药	50,200	3,645,524.00	0.48
29	000069	华侨城A	406,100	3,573,680.00	0.47
30	000768	中航飞机	141,400	3,502,478.00	0.46
31	002241	歌尔声学	99,800	3,453,080.00	0.45
32	000423	东阿阿胶	65,600	3,430,880.00	0.45
33	002304	洋河股份	50,017	3,428,165.18	0.45
34	300017	网宿科技	56,600	3,395,434.00	0.44



35	000559	万向钱潮	144,540	3,270,940.20	0.43
36	002142	宁波银行	210,260	3,261,132.60	0.43
37	002736	国信证券	164,400	3,246,900.00	0.43
38	000402	金融街	273,500	3,153,455.00	0.41
39	002465	海格通信	188,400	3,144,396.00	0.41
40	000728	国元证券	131,700	2,975,103.00	0.39
41	000157	中联重科	550,800	2,946,780.00	0.39
42	000876	新希望	154,500	2,933,955.00	0.38
43	000503	海虹控股	84,800	2,839,952.00	0.37
44	000009	中国宝安	158,100	2,839,476.00	0.37
45	002065	东华软件	112,000	2,811,200.00	0.37
46	300168	万达信息	82,000	2,716,660.00	0.36
47	000623	吉林敖东	87,300	2,701,935.00	0.35
48	000061	农产品	149,932	2,652,297.08	0.35
49	000338	潍柴动力	273,000	2,637,180.00	0.35
50	002252	上海莱士	65,200	2,593,004.00	0.34
51	002292	奥飞动漫	49,900	2,580,329.00	0.34
52	002008	大族激光	99,600	2,578,644.00	0.34
53	000686	东北证券	146,800	2,569,000.00	0.34
54	002466	天齐锂业	18,100	2,547,575.00	0.33
55	002236	大华股份	68,500	2,527,650.00	0.33
56	002405	四维图新	64,600	2,506,480.00	0.33
57	002456	欧菲光	78,700	2,441,274.00	0.32
58	000826	启迪桑德	61,278	2,427,834.36	0.32
59	300058	蓝色光标	160,919	2,370,336.87	0.31
60	000895	双汇发展	115,100	2,349,191.00	0.31
61	000060	中金岭南	164,100	2,302,323.00	0.30
62	002030	达安基因	55,880	2,301,138.40	0.30
63	000977	浪潮信息	71,900	2,279,949.00	0.30
64	000425	徐工机械	535,600	2,276,300.00	0.30
65	002219	恒康医疗	152,177	2,267,437.30	0.30
66	000568	泸州老窖	83,400	2,261,808.00	0.30
67	000750	国海证券	169,800	2,181,930.00	0.29
68	300124	汇川技术	46,100	2,175,920.00	0.28
69	000963	华东医药	26,493	2,171,366.28	0.28
70	300003	乐普医疗	56,000	2,161,600.00	0.28
71	000806	银河生物	74,958	2,138,551.74	0.28
72	002400	省广股份	84,694	2,130,054.10	0.28
73	300315	掌趣科技	151,100	2,115,400.00	0.28

74	002500	山西证券	138,700	2,113,788.00	0.28
75	002049	同方国芯	34,700	2,087,205.00	0.27
76	000540	中天城投	226,551	2,066,145.12	0.27
77	000630	铜陵有色	576,600	2,064,228.00	0.27
78	002340	格林美	135,500	2,059,600.00	0.27
79	000039	中集集团	97,000	2,037,000.00	0.27
80	000413	东旭光电	224,200	2,035,736.00	0.27
81	000997	新大陆	80,050	2,026,866.00	0.27
82	000839	中信国安	99,400	2,022,790.00	0.26
83	002439	启明星辰	62,500	2,000,000.00	0.26
84	002081	金螳螂	107,042	1,999,544.56	0.26
85	000415	渤海租赁	215,900	1,947,418.00	0.25
86	300113	顺网科技	19,200	1,946,304.00	0.25
87	000566	海南海药	50,013	1,943,505.18	0.25
88	000012	南玻A	144,500	1,929,075.00	0.25
89	002004	华邦健康	135,300	1,914,495.00	0.25
90	000712	锦龙股份	65,700	1,913,184.00	0.25
91	002153	石基信息	12,664	1,912,264.00	0.25
92	000792	盐湖股份	74,125	1,903,530.00	0.25
93	000901	航天科技	35,900	1,898,392.00	0.25
94	002276	万马股份	62,700	1,887,270.00	0.25
95	002385	大北农	154,200	1,882,782.00	0.25
96	000998	隆平高科	79,200	1,881,000.00	0.25
97	002701	奥瑞金	65,800	1,859,508.00	0.24
98	300253	卫宁软件	44,400	1,859,472.00	0.24
99	000709	河北钢铁	551,100	1,835,163.00	0.24
100	002475	立讯精密	57,200	1,827,540.00	0.24
101	300079	数码视讯	149,500	1,811,940.00	0.24
102	000031	中粮地产	128,600	1,806,830.00	0.24
103	300408	三环集团	48,200	1,796,896.00	0.24
104	002407	多氟多	23,200	1,769,232.00	0.23
105	002152	广电运通	56,200	1,741,638.00	0.23
106	000938	紫光股份	17,700	1,741,326.00	0.23
107	000046	泛海控股	138,500	1,738,175.00	0.23
108	000410	沈阳机床	69,400	1,736,388.00	0.23
109	000718	苏宁环球	131,309	1,731,965.71	0.23
110	000887	中鼎股份	73,300	1,729,880.00	0.23
111	000078	海王生物	71,800	1,720,328.00	0.23
112	300144	宋城演艺	60,573	1,714,215.90	0.22

113	300251	光线传媒	56,290	1,705,024.10	0.22
114	002573	清新环境	75,900	1,703,196.00	0.22
115	000629	攀钢钒钛	463,000	1,699,210.00	0.22
116	000738	中航动控	53,600	1,694,832.00	0.22
117	002007	华兰生物	38,500	1,694,000.00	0.22
118	000778	新兴铸管	259,500	1,684,155.00	0.22
119	002038	双鹭药业	50,167	1,680,594.50	0.22
120	000581	威孚高科	67,500	1,671,300.00	0.22
121	000988	华工科技	78,700	1,666,866.00	0.22
122	300033	同花顺	23,300	1,655,465.00	0.22
123	000800	一汽轿车	99,800	1,633,726.00	0.21
124	000547	航天发展	85,400	1,626,870.00	0.21
125	002308	威创股份	65,800	1,621,970.00	0.21
126	300088	长信科技	115,600	1,621,868.00	0.21
127	300002	神州泰岳	123,218	1,614,155.80	0.21
128	000831	五矿稀土	77,900	1,612,530.00	0.21
129	000598	兴蓉环境	225,600	1,606,272.00	0.21
130	300142	沃森生物	121,300	1,598,734.00	0.21
131	002176	江特电机	90,720	1,596,672.00	0.21
132	300324	旋极信息	32,400	1,595,700.00	0.21
133	300238	冠昊生物	28,100	1,592,427.00	0.21
134	002268	卫士通	28,100	1,579,501.00	0.21
135	002129	中环股份	129,100	1,577,602.00	0.21
136	000930	中粮生化	106,000	1,566,680.00	0.21
137	000511	烯碳新材	133,700	1,565,627.00	0.21
138	000661	长春高新	12,800	1,541,760.00	0.20
139	300072	三聚环保	45,300	1,538,841.00	0.20
140	002681	奋达科技	35,150	1,536,055.00	0.20
141	300498	温氏股份	33,400	1,527,716.00	0.20
142	300077	国民技术	33,700	1,522,566.00	0.20
143	000656	金科股份	287,800	1,519,584.00	0.20
144	000690	宝新能源	155,000	1,515,900.00	0.20
145	002353	杰瑞股份	59,600	1,512,648.00	0.20
146	000400	许继电气	77,700	1,509,711.00	0.20
147	002657	中科金财	18,800	1,503,812.00	0.20
148	000970	中科三环	106,800	1,498,404.00	0.20
149	002104	恒宝股份	62,300	1,494,577.00	0.20
150	300133	华策影视	50,165	1,494,415.35	0.20
151	002422	科伦药业	80,300	1,493,580.00	0.20

152	002085	万丰奥威	46,340	1,491,221.20	0.20
153	002161	远望谷	66,200	1,476,260.00	0.19
154	300170	汉得信息	74,100	1,470,885.00	0.19
155	002312	三泰控股	52,800	1,467,840.00	0.19
156	300010	立思辰	45,961	1,466,155.90	0.19
157	002310	东方园林	54,600	1,444,716.00	0.19
158	002022	科华生物	49,600	1,443,360.00	0.19
159	000627	天茂集团	133,900	1,440,764.00	0.19
160	002739	万达院线	12,000	1,440,000.00	0.19
161	002146	荣盛发展	150,400	1,433,312.00	0.19
162	000878	云南铜业	103,000	1,426,550.00	0.19
163	000883	湖北能源	231,300	1,420,182.00	0.19
164	000516	国际医学	64,300	1,414,600.00	0.19
165	002131	利欧股份	72,200	1,407,900.00	0.18
166	300244	迪安诊断	20,151	1,401,300.54	0.18
167	000592	平潭发展	69,700	1,392,606.00	0.18
168	000973	佛塑科技	107,100	1,392,300.00	0.18
169	002266	浙富控股	169,840	1,382,497.60	0.18
170	000697	炼石有色	49,600	1,379,872.00	0.18
171	000671	阳光城	152,600	1,377,978.00	0.18
172	002368	太极股份	20,427	1,370,651.70	0.18
173	002410	广联达	75,200	1,367,136.00	0.18
174	000027	深圳能源	139,100	1,364,571.00	0.18
175	002470	金正大	67,000	1,362,780.00	0.18
176	300367	东方网力	19,545	1,362,286.50	0.18
177	300147	香雪制药	54,160	1,354,541.60	0.18
178	300216	千山药机	30,400	1,340,032.00	0.18
179	002273	水晶光电	33,000	1,339,800.00	0.18
180	300055	万邦达	61,190	1,328,434.90	0.17
181	300146	汤臣倍健	34,500	1,328,250.00	0.17
182	000006	深振业A	115,227	1,326,262.77	0.17
183	002179	中航光电	34,900	1,324,804.00	0.17
184	300182	捷成股份	54,900	1,317,600.00	0.17
185	000028	国药一致	19,900	1,316,385.00	0.17
186	300257	开山股份	42,600	1,314,210.00	0.17
187	300287	飞利信	72,300	1,308,630.00	0.17
188	002467	二六三	62,300	1,307,677.00	0.17
189	300020	银江股份	52,872	1,296,421.44	0.17
190	000762	西藏矿业	49,258	1,295,485.40	0.17

191	002191	劲嘉股份	84,300	1,294,848.00	0.17
192	002073	软控股份	76,600	1,294,540.00	0.17
193	002665	首航节能	42,200	1,287,100.00	0.17
194	002250	联化科技	68,200	1,286,934.00	0.17
195	300267	尔康制药	38,300	1,286,880.00	0.17
196	002280	联络互动	20,900	1,283,260.00	0.17
197	000875	吉电股份	139,000	1,277,410.00	0.17
198	000999	华润三九	46,382	1,266,228.60	0.17
199	000939	凯迪生态	87,794	1,264,233.60	0.17
200	000667	美好集团	254,500	1,262,320.00	0.17
201	300274	阳光电源	46,000	1,261,320.00	0.17
202	300291	华录百纳	35,300	1,256,680.00	0.16
203	002375	亚厦股份	79,600	1,255,292.00	0.16
204	002223	鱼跃医疗	32,420	1,246,549.00	0.16
205	300203	聚光科技	36,200	1,241,298.00	0.16
206	002544	杰赛科技	41,823	1,240,051.95	0.16
207	002508	老板电器	27,500	1,236,125.00	0.16
208	300156	神雾环保	24,700	1,234,753.00	0.16
209	300166	东方国信	38,500	1,233,155.00	0.16
210	000729	燕京啤酒	149,800	1,232,854.00	0.16
211	001696	宗申动力	88,600	1,224,452.00	0.16
212	000541	佛山照明	73,050	1,219,935.00	0.16
213	002426	胜利精密	46,800	1,217,736.00	0.16
214	002123	荣信股份	47,300	1,213,245.00	0.16
215	002005	德豪润达	119,500	1,211,730.00	0.16
216	300015	爱尔眼科	38,200	1,206,356.00	0.16
217	000979	中弘股份	301,000	1,204,000.00	0.16
218	002390	信邦制药	83,900	1,203,965.00	0.16
219	002424	贵州百灵	46,900	1,203,454.00	0.16
220	002294	信立泰	39,900	1,201,788.00	0.16
221	300043	互动娱乐	75,700	1,196,060.00	0.16
222	002055	得润电子	30,900	1,194,594.00	0.16
223	000960	锡业股份	87,821	1,182,070.66	0.15
224	000616	海航投资	149,400	1,174,284.00	0.15
225	000829	天音控股	95,100	1,162,122.00	0.15
226	000050	深天马 A	54,700	1,160,187.00	0.15
227	000926	福星股份	68,600	1,155,224.00	0.15
228	002063	远光软件	54,474	1,151,580.36	0.15
229	002690	美亚光电	28,500	1,149,975.00	0.15

230	000156	华数传媒	34,900	1,144,720.00	0.15
231	000816	智慧农业	136,900	1,141,746.00	0.15
232	000983	西山煤电	187,500	1,140,000.00	0.15
233	300273	和佳股份	54,200	1,132,780.00	0.15
234	002261	拓维信息	29,100	1,131,990.00	0.15
235	000758	中色股份	76,000	1,130,880.00	0.15
236	300207	欣旺达	40,000	1,124,000.00	0.15
237	000666	经纬纺机	37,200	1,117,860.00	0.15
238	000825	太钢不锈	272,200	1,116,020.00	0.15
239	000021	深科技	92,466	1,115,139.96	0.15
240	000650	仁和药业	105,200	1,111,964.00	0.15
241	300001	特锐德	38,200	1,107,800.00	0.15
242	300136	信维通信	37,400	1,105,170.00	0.14
243	000777	中核科技	35,200	1,104,928.00	0.14
244	002311	海大集团	78,980	1,103,350.60	0.14
245	002092	中泰化学	125,200	1,101,760.00	0.14
246	002185	华天科技	61,400	1,100,902.00	0.14
247	002501	利源精制	87,500	1,100,750.00	0.14
248	002299	圣农发展	49,800	1,095,102.00	0.14
249	002491	通鼎互联	56,500	1,094,970.00	0.14
250	002474	榕基软件	45,600	1,092,120.00	0.14
251	002428	云南锗业	53,800	1,091,064.00	0.14
252	300212	易华录	23,600	1,089,612.00	0.14
253	000543	皖能电力	128,550	1,088,818.50	0.14
254	002630	华西能源	73,700	1,088,549.00	0.14
255	000587	金叶珠宝	51,000	1,083,750.00	0.14
256	002011	盾安环境	64,700	1,081,784.00	0.14
257	300115	长盈精密	32,100	1,077,597.00	0.14
258	002067	景兴纸业	119,499	1,067,126.07	0.14
259	000687	华讯方舟	39,200	1,059,184.00	0.14
260	002001	新和成	59,950	1,045,528.00	0.14
261	002444	巨星科技	50,500	1,045,350.00	0.14
262	300026	红日药业	49,500	1,044,450.00	0.14
263	300199	翰宇药业	42,400	1,044,312.00	0.14
264	002048	宁波华翔	59,900	1,042,260.00	0.14
265	002050	三花股份	97,500	1,038,375.00	0.14
266	002642	荣之联	17,900	1,036,231.00	0.14
267	002550	千红制药	46,800	1,034,280.00	0.14
268	002489	浙江永强	94,600	1,025,464.00	0.13

269	300178	腾邦国际	35,232	1,025,251.20	0.13
270	300352	北信源	16,400	1,023,360.00	0.13
271	002174	游族网络	11,300	1,011,689.00	0.13
272	002051	中工国际	39,900	1,010,667.00	0.13
273	300054	鼎龙股份	40,900	1,008,594.00	0.13
274	002318	久立特材	65,650	1,004,445.00	0.13
275	002130	沃尔核材	43,800	1,003,896.00	0.13
276	300068	南都电源	50,400	999,936.00	0.13
277	002052	同洲电子	68,110	997,811.50	0.13
278	002373	千方科技	21,800	997,350.00	0.13
279	002429	兆驰股份	78,400	994,896.00	0.13
280	300101	振芯科技	33,500	988,585.00	0.13
281	000670	盈方微	62,100	984,906.00	0.13
282	000158	常山股份	48,300	982,905.00	0.13
283	000733	振华科技	39,200	980,000.00	0.13
284	000601	韶能股份	89,000	979,890.00	0.13
285	300085	银之杰	17,505	978,529.50	0.13
286	300271	华宇软件	20,598	977,993.04	0.13
287	000681	视觉中国	25,700	976,857.00	0.13
288	002195	二三四五	26,400	976,800.00	0.13
289	300347	泰格医药	31,700	974,458.00	0.13
290	002583	海能达	77,620	969,473.80	0.13
291	000685	中山公用	68,400	967,860.00	0.13
292	000860	顺鑫农业	45,300	964,890.00	0.13
293	000558	莱茵体育	34,800	963,960.00	0.13
294	002013	中航机电	42,500	963,050.00	0.13
295	002303	美盈森	69,900	954,135.00	0.12
296	002570	贝因美	63,700	951,041.00	0.12
297	002271	东方雨虹	48,684	950,798.52	0.12
298	002672	东江环保	46,950	946,981.50	0.12
299	000488	晨鸣纸业	106,000	945,520.00	0.12
300	002588	史丹利	29,000	943,370.00	0.12
301	002190	成飞集成	21,500	940,840.00	0.12
302	000089	深圳机场	115,200	940,032.00	0.12
303	000851	高鸿股份	60,100	939,363.00	0.12
304	300336	新文化	22,330	937,860.00	0.12
305	002089	新海宜	41,600	936,416.00	0.12
306	000861	海印股份	119,850	926,440.50	0.12
307	000897	津滨发展	161,600	921,120.00	0.12

308	002376	新北洋	49,800	920,304.00	0.12
309	000786	北新建材	77,300	919,870.00	0.12
310	000563	陕国投 A	60,700	917,784.00	0.12
311	300202	聚龙股份	28,500	917,415.00	0.12
312	000652	泰达股份	128,500	916,205.00	0.12
313	000513	丽珠集团	15,950	916,008.50	0.12
314	002285	世联行	56,400	915,372.00	0.12
315	000518	四环生物	127,700	906,670.00	0.12
316	000732	泰禾集团	37,000	906,500.00	0.12
317	002023	海特高新	49,400	905,996.00	0.12
318	002396	星网锐捷	37,500	905,625.00	0.12
319	000751	锌业股份	140,600	902,652.00	0.12
320	002399	海普瑞	25,500	901,935.00	0.12
321	002221	东华能源	38,500	900,130.00	0.12
322	000572	海马汽车	140,400	898,560.00	0.12
323	000680	山推股份	117,200	896,580.00	0.12
324	002437	誉衡药业	29,600	895,400.00	0.12
325	002095	生意宝	12,140	893,382.60	0.12
326	300171	东富龙	29,700	890,406.00	0.12
327	002138	顺络电子	62,000	889,700.00	0.12
328	002269	美邦服饰	132,500	889,075.00	0.12
329	300159	新研股份	53,500	888,100.00	0.12
330	002551	尚荣医疗	26,913	887,321.61	0.12
331	002344	海宁皮城	57,735	885,654.90	0.12
332	002714	牧原股份	18,700	880,209.00	0.12
333	000848	承德露露	53,300	879,450.00	0.12
334	000830	鲁西化工	126,800	878,724.00	0.12
335	002563	森马服饰	70,200	870,480.00	0.11
336	000969	安泰科技	66,500	863,170.00	0.11
337	002121	科陆电子	29,000	858,400.00	0.11
338	002366	台海核电	13,000	857,350.00	0.11
339	000519	江南红箭	50,020	849,339.60	0.11
340	300090	盛运环保	72,400	847,804.00	0.11
341	300134	大富科技	28,100	845,810.00	0.11
342	002477	雏鹰农牧	50,000	845,500.00	0.11
343	002106	莱宝高科	63,325	844,755.50	0.11
344	300011	鼎汉技术	28,300	843,340.00	0.11
345	300039	上海凯宝	60,740	841,856.40	0.11
346	300012	华测检测	34,100	838,519.00	0.11



347	002019	亿帆鑫富	20,900	836,000.00	0.11
348	000931	中关村	65,700	834,390.00	0.11
349	300288	朗玛信息	13,500	833,220.00	0.11
350	002326	永太科技	39,600	833,184.00	0.11
351	300032	金龙机电	27,400	832,960.00	0.11
352	000801	四川九洲	26,900	832,017.00	0.11
353	002108	沧州明珠	46,860	828,016.20	0.11
354	300053	欧比特	20,200	823,150.00	0.11
355	002215	诺普信	42,813	821,153.34	0.11
356	300122	智飞生物	22,500	818,550.00	0.11
357	000049	德赛电池	14,400	817,632.00	0.11
358	002074	国轩高科	21,900	812,490.00	0.11
359	002595	豪迈科技	35,800	812,302.00	0.11
360	002603	以岭药业	44,603	808,652.39	0.11
361	002099	海翔药业	33,900	808,515.00	0.11
362	002249	大洋电机	60,900	807,534.00	0.11
363	300005	探路者	35,100	803,790.00	0.11
364	000062	深圳华强	21,800	797,880.00	0.10
365	000898	鞍钢股份	167,055	796,852.35	0.10
366	002482	广田股份	27,100	792,675.00	0.10
367	000528	柳工	95,500	791,695.00	0.10
368	002242	九阳股份	34,900	791,532.00	0.10
369	002168	深圳惠程	66,900	791,427.00	0.10
370	002028	思源电气	49,400	784,966.00	0.10
371	002384	东山精密	39,100	782,782.00	0.10
372	000539	粤电力A	106,407	782,091.45	0.10
373	002025	航天电器	30,070	781,519.30	0.10
374	000090	天健集团	45,900	781,218.00	0.10
375	002555	顺荣三七	15,800	771,988.00	0.10
376	002029	七匹狼	56,300	769,621.00	0.10
377	002244	滨江集团	96,200	765,752.00	0.10
378	002358	森源电气	41,500	765,675.00	0.10
379	002155	湖南黄金	85,100	765,049.00	0.10
380	002047	宝鹰股份	67,900	763,196.00	0.10
381	002527	新时达	34,550	759,754.50	0.10
382	000555	神州信息	17,900	753,590.00	0.10
383	002177	御银股份	69,400	752,990.00	0.10
384	002440	闰土股份	39,500	752,475.00	0.10
385	000961	中南建设	48,400	748,264.00	0.10

386	002498	汉缆股份	100,400	746,976.00	0.10
387	000902	新洋丰	24,401	743,010.45	0.10
388	000726	鲁泰 A	54,900	742,248.00	0.10
389	002181	粤传媒	46,800	741,780.00	0.10
390	000807	云铝股份	102,200	734,818.00	0.10
391	002041	登海种业	43,500	732,975.00	0.10
392	002698	博实股份	24,990	732,956.70	0.10
393	300228	富瑞特装	23,400	730,080.00	0.10
394	000426	兴业矿业	103,100	727,886.00	0.10
395	000735	罗牛山	95,940	726,265.80	0.10
396	000900	现代投资	86,500	725,735.00	0.10
397	300229	拓尔思	23,100	725,340.00	0.09
398	300157	恒泰艾普	59,400	725,274.00	0.09
399	002414	高德红外	23,739	723,327.33	0.09
400	300295	三六五网	14,500	719,200.00	0.09
401	000401	冀东水泥	65,900	718,310.00	0.09
402	000088	盐田港	82,700	712,874.00	0.09
403	000933	神火股份	142,300	708,654.00	0.09
404	000767	漳泽电力	122,300	705,671.00	0.09
405	002431	棕榈园林	26,220	703,744.80	0.09
406	000099	中信海直	47,600	703,528.00	0.09
407	300075	数字政通	22,400	702,240.00	0.09
408	002421	达实智能	31,990	700,581.00	0.09
409	002093	国脉科技	47,000	699,360.00	0.09
410	002151	北斗星通	13,400	699,212.00	0.09
411	002317	众生药业	52,800	699,072.00	0.09
412	002178	延华智能	52,500	696,150.00	0.09
413	300137	先河环保	33,000	691,350.00	0.09
414	000996	中国中期	24,200	685,586.00	0.09
415	002433	太安堂	46,100	685,046.00	0.09
416	300183	东软载波	25,400	685,038.00	0.09
417	002064	华峰氨纶	105,500	684,695.00	0.09
418	300197	铁汉生态	39,800	680,978.00	0.09
419	002309	中利科技	36,200	679,836.00	0.09
420	002154	报喜鸟	88,800	675,768.00	0.09
421	002262	恩华药业	23,000	673,210.00	0.09
422	002556	辉隆股份	36,400	673,036.00	0.09
423	002577	雷柏科技	11,700	669,474.00	0.09
424	002056	横店东磁	23,800	669,018.00	0.09

425	300339	润和软件	13,900	667,478.00	0.09
426	002229	鸿博股份	22,400	666,624.00	0.09
427	002197	证通电子	24,900	664,332.00	0.09
428	002009	天奇股份	32,000	664,000.00	0.09
429	002663	普邦园林	83,600	663,784.00	0.09
430	002339	积成电子	27,100	661,240.00	0.09
431	002463	沪电股份	101,800	657,628.00	0.09
432	002277	友阿股份	46,900	651,441.00	0.09
433	000620	新华联	64,401	651,094.11	0.09
434	000915	山大华特	18,400	646,944.00	0.08
435	002522	浙江众成	34,900	646,697.00	0.08
436	000739	普洛药业	78,800	646,160.00	0.08
437	000975	银泰资源	51,501	644,792.52	0.08
438	000958	东方能源	25,000	643,000.00	0.08
439	000550	江铃汽车	21,400	641,572.00	0.08
440	000937	冀中能源	127,190	641,037.60	0.08
441	300226	上海钢联	12,600	638,820.00	0.08
442	002480	新筑股份	49,800	637,440.00	0.08
443	002170	芭田股份	48,201	632,397.12	0.08
444	002078	太阳纸业	112,300	632,249.00	0.08
445	000731	四川美丰	65,400	630,456.00	0.08
446	002649	博彦科技	11,200	630,336.00	0.08
447	000417	合肥百货	57,400	627,382.00	0.08
448	000869	张裕A	13,700	627,186.00	0.08
449	002342	巨力索具	82,100	624,781.00	0.08
450	000600	建投能源	58,600	624,676.00	0.08
451	002217	合力泰	36,700	622,065.00	0.08
452	002237	恒邦股份	62,300	621,754.00	0.08
453	300185	通裕重工	67,400	619,406.00	0.08
454	002079	苏州固锝	56,000	610,960.00	0.08
455	002540	亚太科技	60,800	606,784.00	0.08
456	300074	华平股份	41,100	605,814.00	0.08
457	000506	中润资源	63,200	605,456.00	0.08
458	002071	长城影视	34,000	603,500.00	0.08
459	300111	向日葵	91,300	600,754.00	0.08
460	000812	陕西金叶	46,800	599,040.00	0.08
461	002638	勤上光电	39,000	597,480.00	0.08
462	000693	华泽钴镍	32,000	596,160.00	0.08
463	300355	蒙草抗旱	33,400	595,856.00	0.08

464	000877	天山股份	74,101	595,031.03	0.08
465	002625	龙生股份	12,200	593,530.00	0.08
466	002505	大康牧业	69,600	590,904.00	0.08
467	000987	广州友谊	22,500	589,275.00	0.08
468	002122	天马股份	70,600	588,098.00	0.08
469	002233	塔牌集团	40,100	587,465.00	0.08
469	300316	晶盛机电	40,100	587,465.00	0.08
470	300205	天喻信息	28,200	582,048.00	0.08
471	000554	泰山石油	47,000	581,390.00	0.08
472	002432	九安医疗	23,500	580,450.00	0.08
473	300034	钢研高纳	22,100	579,020.00	0.08
474	002298	中电鑫龙	29,600	568,616.00	0.07
475	300052	中青宝	19,600	568,204.00	0.07
476	002658	雪迪龙	20,700	562,833.00	0.07
477	300433	蓝思科技	6,700	558,646.00	0.07
478	002408	齐翔腾达	41,689	554,880.59	0.07
479	000507	珠海港	74,200	549,822.00	0.07
480	002251	步步高	33,730	549,799.00	0.07
481	002369	卓翼科技	40,700	541,310.00	0.07
482	300152	科融环境	48,100	539,201.00	0.07
483	002240	威华股份	39,300	537,624.00	0.07
484	002203	海亮股份	47,800	525,800.00	0.07
485	000596	古井贡酒	14,400	525,600.00	0.07
486	002313	日海通讯	35,500	525,400.00	0.07
487	002653	海思科	23,416	512,576.24	0.07
488	300369	绿盟科技	9,900	481,536.00	0.06
489	002128	露天煤业	56,000	473,200.00	0.06
490	002235	安妮股份	16,200	471,420.00	0.06
491	000553	沙隆达 A	43,500	465,450.00	0.06
492	002493	荣盛石化	29,500	457,250.00	0.06
493	002307	北新路桥	39,500	445,560.00	0.06
494	300148	天舟文化	25,200	443,520.00	0.06
495	000151	中成股份	16,000	391,040.00	0.05
496	002773	康弘药业	4,500	369,900.00	0.05
497	300276	三丰智能	14,500	369,170.00	0.05
498	300413	快乐购	7,000	277,200.00	0.04
499	000727	华东科技	27,600	273,516.00	0.04
500	000748	长城信息	7,700	268,576.00	0.04
501	002018	华信国际	5,900	260,072.00	0.03

502	000066	长城电脑	7,900	170,166.00	0.02
503	002785	万里石	500	2,920.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	43,796,198.83	5.73
2	000002	万科A	40,568,562.28	5.31
3	000725	京东方A	39,808,572.70	5.21
4	000001	平安银行	30,979,870.44	4.06
5	300059	东方财富	26,103,679.60	3.42
6	000333	美的集团	24,579,857.62	3.22
7	002024	苏宁云商	23,294,592.56	3.05
8	000776	广发证券	21,923,926.68	2.87
9	000166	申万宏源	19,583,442.52	2.56
10	000100	TCL 集团	17,767,418.00	2.33
11	300104	乐视网	17,494,528.20	2.29
12	002415	海康威视	17,416,543.71	2.28
13	000858	五粮液	17,207,313.12	2.25
14	000783	长江证券	16,070,231.80	2.10
15	000063	中兴通讯	15,945,707.00	2.09
16	000768	中航飞机	15,873,204.25	2.08
17	000069	华侨城A	14,147,494.55	1.85
18	002450	康得新	13,743,477.82	1.80
19	300024	机器人	13,394,077.59	1.75
20	000157	中联重科	12,906,061.40	1.69

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。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000024	招商地产	6,532,485.30	0.86

2	002104	恒宝股份	3,842,961.00	0.50
3	300332	天壕环境	3,579,965.78	0.47
4	300347	泰格医药	3,425,853.05	0.45
5	002415	海康威视	2,548,378.90	0.33
6	300367	东方网力	2,424,159.00	0.32
7	002024	苏宁云商	1,903,906.00	0.25
8	300336	新文化	1,713,831.00	0.22
9	300027	华谊兄弟	1,593,062.00	0.21
10	300168	万达信息	1,432,883.00	0.19
11	300355	蒙草抗旱	1,314,661.35	0.17
12	000503	海虹控股	1,209,624.00	0.16
13	000009	中国宝安	1,159,012.00	0.15
14	000768	中航飞机	1,098,389.00	0.14
15	300014	亿纬锂能	1,077,719.30	0.14
16	002400	省广股份	938,050.00	0.12
17	002216	三全食品	922,670.14	0.12
18	000651	格力电器	892,776.00	0.12
19	002681	奋达科技	884,803.00	0.12
20	300295	三六五网	884,716.07	0.12

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。

#### 8.4.3 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	2,324,682,285.64
卖出股票收入（成交）总额	134,718,670.70

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00

6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	130,400.00	0.02
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	130,400.00	0.02

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	1,304	130,400.00	0.02

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 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。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

本基金投资的前十名证券之一广发证券，2015年8月24日因“涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为”收到中国证监会《调查通知书》（鄂证调查字2015023号）。2015年9月10日因“涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案”收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71号）。本基金认为，对广发证券的调查及处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	1,440,150.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,555.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,442,706.40

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末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	000002	万科A	29,010,625.00	3.80	重大事项
2	300104	乐视网	8,290,800.00	1.09	重大事项

### 8.12.6 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。



## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

## 9.1.1 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
13,764	4,223.72	7,781,340.00	13.38%	50,354,002.00	86.62%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 9.2 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	南澳县江海船务代理有限公司	3,236,300.00	5.57%
2	申银万国证券股份有限公司	1,939,151.00	3.34%
3	信诚人寿保险有限公司一分红账户	1,716,361.00	2.95%
4	许贤明	484,382.00	0.83%
5	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.34%
6	林莹	197,096.00	0.34%
7	戴济民	196,967.00	0.34%
8	贺雅宁	196,965.00	0.34%
9	寇胜利	196,694.00	0.34%
10	吕君	180,000.00	0.31%

## 9.3 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%

## 9.4 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月5日）基金份额总额	2,384,588,069.00
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	292,500,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	390,900,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-2,228,052,727.00
本报告期期末基金份额总额	58,135,342.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况

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。

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 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十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 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十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

## 二、基金托管人在本报告期内重大人事变动情况

无。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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)，本年度应支付的审计费用为 105,000.00 元。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。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	
银河证券	4	1,044,545,610.89	42.70%	924,326.25	42.58%	新增
招商证券	2	785,734,259.27	32.12%	695,302.60	32.03%	新增
光大证券	2	319,171,958.08	13.05%	288,570.36	13.29%	新增
海通证券	1	220,634,841.29	9.02%	195,241.29	8.99%	新增
国泰君安	2	76,248,171.21	3.12%	67,473.04	3.11%	新增
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增

中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	0.00%	2,400,000,000.00	100.00%	-	0.00%

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
1	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金关于增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/22
2	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金2015年第3季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/24
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金关于增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/7
4	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金关于增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/16
5	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金关于增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/8
6	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/8
7	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金关于增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/3

9	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/1
10	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/25
11	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/6
12	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为网下股票发售代理机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/27
13	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金增加招商证券为网下股票发售代理机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/23
14	关于大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为网下股票发售代理机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/16
15	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金份额上网发售提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/11
16	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/6
17	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/6
18	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/6
19	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/6
20	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/6
21	大成基金管理有限公司 关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/7
22	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
23	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
24	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
25	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
26	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24
27	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24
28	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

29	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
30	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
31	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
32	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
33	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
34	“大成上上签”活动获奖名单	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
35	大成基金电子直销交易系统维护通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
36	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/12
37	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
38	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
39	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
40	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/31
41	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
42	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/14
43	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/17
44	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
45	大成基金管理有限公司关于增加联讯证券股份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	2015/5/5
46	关于大成基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/7
47	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
48	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/9

49	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/9
50	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/12
51	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
52	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
53	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
54	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/2
55	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/3
56	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/8
57	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/11
58	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
59	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/27
60	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
61	大成基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
62	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
63	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/27
64	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29
65	关于大成基金管理有限公司上海理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/13
66	大成基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2015/8/14
67	大成基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/22
68	大成基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/1



69	大成基金管理有限公司关于增加南京证券有限责任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	2015/9/12
70	大成基金管理有限公司关于增加南京证券有限责任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	2015/9/15
71	大成基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售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	2015/9/17
72	大成基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
73	大成基金管理有限公司关于参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
74	大成基金管理有限公司关于增加上海银行股份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	2015/9/30
75	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	2015/10/15
76	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/15
77	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	2015/10/16
78	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
79	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
80	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	2015/10/30
81	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/10
82	关于增加深圳市新兰德证券投资咨询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	2015/11/16
83	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/28
84	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/2
85	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/17
86	大成基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份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	2015/12/18
87	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29

88	大成基金管理有限公司关于网上直销系统暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
89	大成基金管理有限公司关于指数熔断机制对公司旗下公募基金相关业务事项影响的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

备查文件存放于本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 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  
2016年3月26日