

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
2016 年年度报告
2016 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：2017 年 3 月 25 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 2017 年 3 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
8.12 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 其他重大事件.....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

§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	40,735,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	罗登攀	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599

传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
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	2016 年	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	-38,511,531.27	-406,999,068.76
本期利润	-135,511,031.26	-393,853,788.97
加权平均基金份额本期利润	-2.7057	-1.1359
本期加权平均净值利润率	-24.85%	-32.31%
本期基金份额净值增长率	-18.69%	-13.75%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-186,039,686.78	-220,806,172.35
期末可供分配基金份额利润	-4.5670	-3.7981
期末基金资产净值	435,153,307.18	763,719,894.04
期末基金份额净值	10.682	13.137
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-29.87%	-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）。

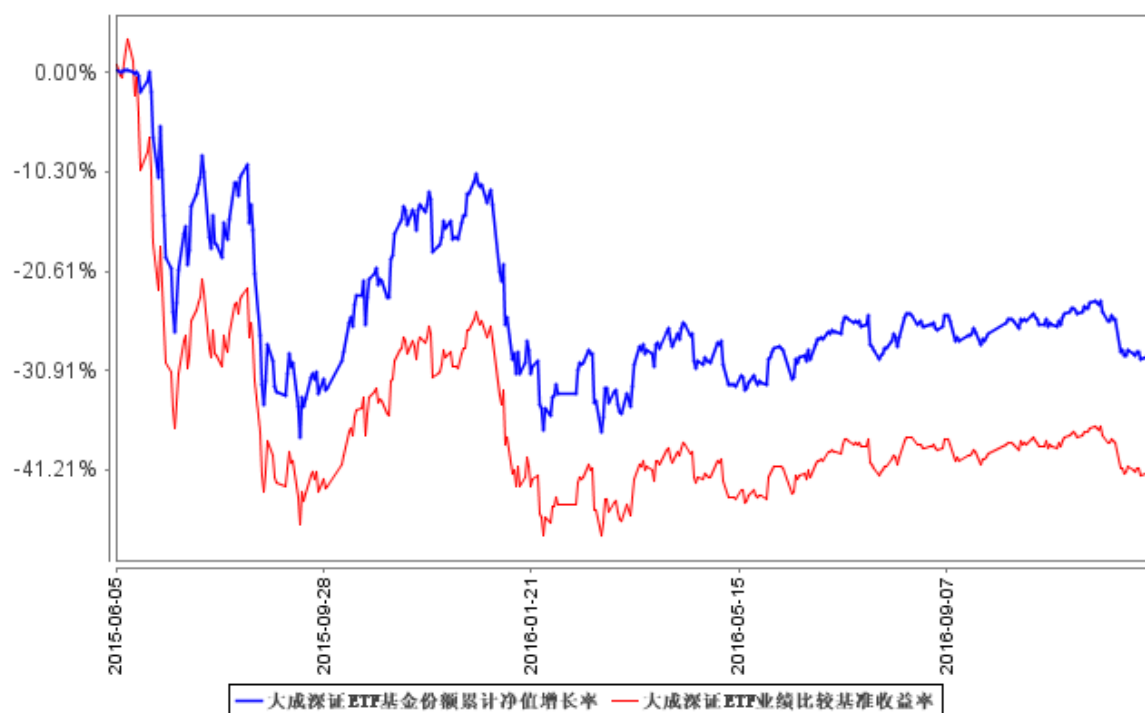
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

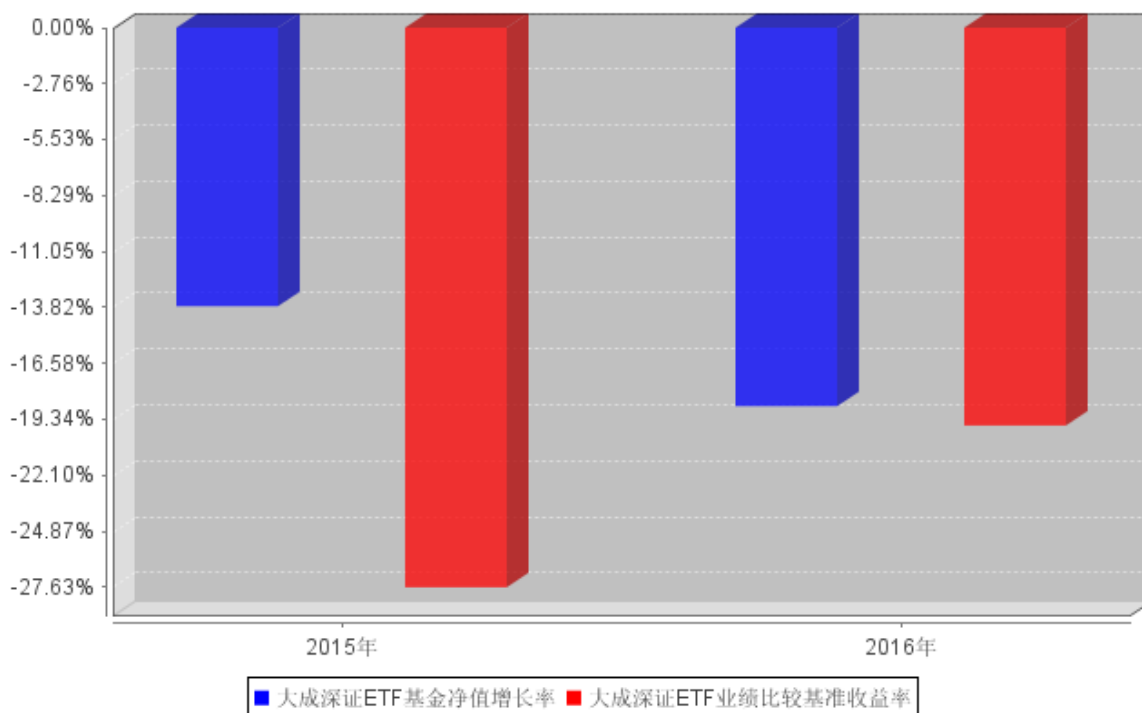
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.79%	0.84%	-3.69%	0.85%	-0.10%	-0.01%
过去六个月	-3.24%	0.92%	-2.98%	0.93%	-0.26%	-0.01%
过去一年	-18.69%	1.73%	-19.64%	1.80%	0.95%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-29.87%	2.23%	-41.85%	2.34%	11.98%	-0.11%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2016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，4只QDII

基金及 68 只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2015 年 6 月 5 日	-	13 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 4 日起担任大成核心双

					动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。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	本基金基金经理助理	2015 年 7 月 20 日	-	8 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 日起任中证 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，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 9 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年国际政局风起云涌，超预期事件层出不穷，包括英国公投脱欧、全球“负利率”政策逆转、川普当选美国总统等。尽管全球经济逐渐有所起色，但政经环境的不确定性仍然压制着投资者的风险偏好。

国内经济环境虽然未如国外动荡，但也并不平稳。年初，在供给侧改革、去库存、投资需求拉动等措施的共振下，宏观经济有了起色。新增信贷放出巨量，PMI 等经济数据都得到了明显改善。在需求回暖和资金炒作叠加作用下，以黑色系为代表的大宗商品价格大幅反弹。后来，在权威人士表态定调经济“L”型后，情况发生了变化，政策刺激力度明显减弱，经济重新回到筑底的轨道上。虽然房贷继续放量，但除此之外社会融资需求大大萎缩，资金脱实向虚愈演愈烈。实体经济回报不佳，巨量流动性只能继续推高资产价格，收益预期相对稳定的固收及类固收资产均受到追捧。然而，进入四季度情况却开始发生变化，宏观经济整体呈现短期企稳、物价上升、货币偏紧的态势。同时在美元升值等因素的共同作用下，人民币相对美元出现了较大幅度的贬值。迫于资金外流压力，政府将防控金融风险放到了更重要位置，执行偏审慎的货币政策，控制资产泡沫，金融市场也受到了较大的影响。

股市在 2016 年也经历了较大的波动。股灾余波未了，在 2016 年伊始股市便连续向下熔断。虽然监管部门及时调整政策，取消了熔断交易规则，但股市还是需要较长的时间才恢复元气。市场阶段性出清后，走出了“慢牛”行情，直至四季度险资撤退，流动性收缩，股债双杀，才出现了较大的调整。全年市场基准沪深 300 指数下跌 11.28%，价值型股票优势明显，成长风格受挫。在行业方面，食品饮料行业在弱市中表现出非常好的防御性，一枝独秀领涨大市，建筑、家电、银行等蓝筹股集中地板块也表现良好；而传媒、计算机等行业则表现较差。

本基金标的指数深成指下跌 19.64%，跌幅高于大盘。本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。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 10.682 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.69%，同期业绩比较基准收益率为-19.64%，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

展望新的年度，国际环境暗流涌动，不确定性与日俱增。美国依旧是全球市场关注的焦点，尤其是特朗普宣誓就职后，所推行的保守主义政策超出预期，加大了市场对未来世界格局不确定性的担忧。全球范围内的贸易摩擦将会有所加大，外需难以对国内经济构成支撑。

在国内供给侧改革推进、基建项目拉动等因素共同作用下，商品价格稳步上涨，CPI、PPI 已然走出低谷，通缩的担忧暂时消退。虽然宏观经济数据正在改善，但经济内生动力仍然不足。在“脱虚向实”方针指导下，财政刺激配合货币中性的政策组合预计仍将在新的年度继续执行。

展望明年股市，暂时还很难有系统性的牛市行情。去杠杆依然是金融市场的主基调，作为金融市场的一部分，权益市场处于下行的趋势当中。在一波三折的下行中，阶段性反弹可期，但不太可能走出大规模的行情。另一方面，在严密的监管下，市场急速下跌的风险也较小。市场的主要机会将来自于短期超跌后的修复，以及个别优秀的股票可能走出的独立行情。此外，现行新股发行制度有可能导致市场风格继续分化，进一步压缩成长股估值溢价。

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、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历, 估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态, 评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种; 提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量; 定期对估值政策和程序进行评价, 以保证其持续适用; 基金运营部负责日常的基金资产的估值业务, 执行基金估值政策, 并负责与托管行沟通估值调整事项; 监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性, 监督估值委员会工作流程中的风险控制, 并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行, 并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制, 基金经理及投资经理作为估值小组成员, 对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感, 向估值委员会提供估值参考信息, 参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券, 基金管理人及时启动特别估值程序, 由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

4.8 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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，未发现有关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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 1 月 1 日至 2016 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

	<p>基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	<p>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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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	2017 年 3 月 24 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	7.4.7.1	4,117,850.66	9,661,424.60
结算备付金		4,794.28	298,257.90
存出保证金		13,736.64	1,440,150.78
交易性金融资产	7.4.7.2	431,449,359.25	758,516,505.19
其中：股票投资		431,449,359.25	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	842.50	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		435,586,583.33	769,918,894.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
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	7.4.10.2.1	190,230.13	354,600.55
应付托管费	7.4.10.2.2	38,046.02	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	205,000.00	221,756.22
负债合计		433,276.15	6,199,000.05
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	620,543,637.48	885,607,308.57
未分配利润	7.4.7.10	-185,390,330.30	-121,887,414.53
所有者权益合计		435,153,307.18	763,719,894.04
负债和所有者权益总计		435,586,583.33	769,918,894.09

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 10.682 元，基金份额总额 40,735,342.00 份。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 5 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-131,411,942.11	-386,659,073.14
1.利息收入		46,570.50	2,147,400.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	46,531.34	1,087,368.94
债券利息收入		39.16	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）		-34,459,012.62	-400,966,002.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-40,190,412.04	-406,100,608.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	27,024.83	-
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	5,704,374.59	5,134,605.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-96,999,499.99	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
减：二、费用		4,099,089.15	7,194,715.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,733,729.48	3,455,301.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	546,745.93	691,060.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	243,113.74	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	575,500.00	473,803.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-135,511,031.26	-393,853,788.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-135,511,031.26	-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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	885,607,308.57	-121,887,414.53	763,719,894.04
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-135,511,031.26	-135,511,031.26
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)	-265,063,671.09	72,008,115.49	-193,055,555.60
其中：1.基金申购款	4,570,063.29	-1,134,612.56	3,435,450.73
2.基金赎回款	-269,633,734.38	73,142,728.05	-196,491,006.33
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	620,543,637.48	-185,390,330.30	435,153,307.18
项目	上年度可比期间 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 周立新
 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 2017 年 3 月 24 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 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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。比较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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改

征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

(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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,117,850.66	9,661,424.60
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,117,850.66	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 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	515,303,579.45	431,449,359.25	-83,854,220.20

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	515,303,579.45	431,449,359.25	-83,854,220.20
项目	上年度末 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

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	834.10	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	2.20	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	6.20	648.10
合计	842.50	2,555.62

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付指数使用费	50,000.00	66,756.22
预提费用	155,000.00	155,000.00
合计	205,000.00	221,756.22

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,135,342.00	885,607,308.57
本期申购	300,000.00	4,570,063.29
本期赎回(以“-”号填列)	-17,700,000.00	-269,633,734.38
本期末	40,735,342.00	620,543,637.48

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
上年度末	-220,806,172.35	98,918,757.82	-121,887,414.53
本期利润	-38,511,531.27	-96,999,499.99	-135,511,031.26
本期基金份额交易产生的变动数	73,278,016.84	-1,269,901.35	72,008,115.49
其中：基金申购款	-1,365,491.29	230,878.73	-1,134,612.56
基金赎回款	74,643,508.13	-1,500,780.08	73,142,728.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-186,039,686.78	649,356.48	-185,390,330.30

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 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	43,656.74	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	1,782.73	70,927.13
其他	1,091.87	6,893.27
合计	46,531.34	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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 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	-10,424,253.16	-8,955,723.58
股票投资收益——赎回差价收入	-29,766,158.88	-397,144,884.56
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-40,190,412.04	-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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 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	82,455,789.84	134,718,670.70
减：卖出股票成本总额	92,880,043.00	143,674,394.28
买卖股票差价收入	-10,424,253.16	-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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 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	196,491,006.33	4,961,624,685.60
减：现金支付赎回款总额	7,465,064.33	826,398,016.60
减：赎回股票成本总额	218,792,100.88	4,532,371,553.56
赎回差价收入	-29,766,158.88	-397,144,884.56

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年6月5日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	208,584.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	181,500.00	-
减：应收利息总额	59.17	-
买卖债券差价收入	27,024.83	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 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	5,704,374.59	5,134,605.33
合计	5,704,374.59	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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 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	-96,999,499.99	13,145,279.79
——股票投资	-96,999,499.99	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	-96,999,499.99	13,145,279.79

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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	243,113.74	2,574,551.06
银行间市场交易费用	-	-
合计	243,113.74	2,574,551.06

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	75,000.00	105,000.00
信息披露费	240,000.00	100,000.00
其他	100.00	500.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	400.00	985.00
指数使用费	200,000.00	207,318.10
合计	575,500.00	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

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号), 要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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(2016 年 4 月 25 日前)
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. 根据本基金管理人大成基金董事会及股东会的有关决议, 大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
光大证券	160,643,071.97	100.00%	319,171,958.08	13.05%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
光大证券	208,584.00	100.00%	-	0.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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 总量的比例
光大证券	146,398.56	100.00%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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 总量的比例
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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	2,733,729.48	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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	546,745.93	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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	4,117,850.66	43,656.74	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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	486,360	4,237,869.32	3,039,750.00	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大资产重组	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	82,600	3,770,897.15	2,957,080.00	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	211,151	2,060,544.93	1,463,276.43	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大资产重组	15.80	-	-	83,300	976,666.63	1,316,140.00	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大资产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	48,200	1,176,094.81	1,250,308.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大资产重组	20.31	-	-	60,700	1,482,899.16	1,232,817.00	-

000750	国海证券	2016年12月15日	重大事项	6.97	2017年1月20日	6.27	170,550	1,445,702.64	1,188,733.50	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.27	-	-	142,500	2,284,274.96	1,178,475.00	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大资产重组	15.36	2017年1月3日	16.90	74,000	1,877,680.12	1,136,640.00	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大资产重组	16.12	-	-	64,600	738,373.56	1,041,352.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	75,342	1,574,094.66	1,038,966.18	-
000050	深天马A	2016年9月12日	重大资产重组	18.82	2017年3月23日	20.70	53,400	1,112,365.39	1,004,988.00	-
000516	国际医学	2016年12月5日	重大事项	7.90			120,400	969,158.70	951,160.00	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	重大资产重组	23.51	-	-	35,800	672,742.88	841,658.00	-
000727	华东科技	2016年11月17日	重大资产重组	3.37	2017年2月15日	3.47	222,800	823,844.37	750,836.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	45,800	859,565.46	711,732.00	-
002602	世纪华通	2016年12月15日	重大事项	46.89	2017年1月9日	50.00	14,839	278,721.02	695,800.71	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大资产重组	7.48	2017年1月18日	6.73	89,100	503,379.81	666,468.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大资产重组	20.04	-	-	32,462	665,097.50	650,538.48	-

300271	华宇软件	2016年12月19日	重大资产重组	17.45	-	-	35,831	858,590.24	625,250.95	-
002440	闰土股份	2016年10月21日	重大资产重组	16.34	2017年1月12日	15.22	37,600	741,784.92	614,384.00	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	54,400	722,502.04	613,632.00	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大资产重组	15.84	2017年1月23日	14.26	36,700	592,633.36	581,328.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大资产重组	25.20	-	-	22,670	732,807.36	571,284.00	-
300212	易华录	2016年11月30日	重大资产重组	34.00	-	-	16,300	753,065.25	554,200.00	-
000558	莱茵体育	2016年10月17日	重大资产重组	14.75	-	-	37,400	964,663.61	551,650.00	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大资产重组	19.70	2017年2月21日	18.35	27,500	668,884.26	541,750.00	-
300496	中科创达	2016年10月11日	重大资产重组	52.28	2017年1月6日	47.49	9,300	637,775.83	486,204.00	-
002151	北斗星通	2016年11月16日	重大资产重组	31.90	2017年1月12日	31.00	14,150	504,845.97	451,385.00	-
002071	长城影视	2016年6月15日	重大资产重组	13.64	2017年1月3日	15.00	30,000	472,999.15	409,200.00	-
300005	探路者	2016年11月28日	重大资产重组	16.69	2017年2月6日	15.02	23,800	597,065.24	397,222.00	-
000987	越秀金控	2016年8月29日	重大资产重组	14.49	2017年1月9日	15.94	24,750	391,559.68	358,627.50	-

000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大资产重组	12.50	-	-	26,800	517,816.87	335,000.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	12.93	-	-	25,700	438,781.45	332,301.00	-

注：本基金截至 2016 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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2015 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 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 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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 2016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	4,117,850.66	-	-	-	4,117,850.66
结算备付金	4,794.28	-	-	-	4,794.28
存出保证金	13,736.64	-	-	-	13,736.64
交易性金融资产	-	-	-	431,449,359.25	431,449,359.25
应收利息	-	-	-	842.50	842.50
资产总计	4,136,381.58	-	-	431,450,201.75	435,586,583.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	190,230.13	190,230.13
应付托管费	-	-	-	38,046.02	38,046.02
其他负债	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	433,276.15	433,276.15
利率敏感度缺口	4,136,381.58	-	-	431,016,925.60	435,153,307.18
上年度末 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
应收利息	-	-	-	2,555.62	2,555.62
资产总计	11,399,833.28	-	130,400.00	758,388,660.81	769,918,894.09
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
负债总计	-	-	-	6,199,000.05	6,199,000.05
利率敏感度缺口	11,399,833.28	-	130,400.00	752,189,660.76	763,719,894.04

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：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(2015 年 12 月 31 日：同)。

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	431,449,359.25	99.15	758,386,105.19	99.30
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	431,449,359.25	99.15	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:人民币万元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 2,095	增加约 3,502
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 2,095	减少约 3,502

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间, 本基金申购基金份额的对价总额为 3,435,450.73 元, 其中包括以股票支付的申购款 3,136,169.00 元和以现金支付的申购款 299,281.73 元。(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 2016 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 400,909,221.50 元, 属于第二层次的余额为 30,540,137.75 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 675,929,646.34 元, 第二层次 82,586,858.85 元, 无属于第三层次的余额)。

(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 2016 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(2015 年 12 月 31 日：同)。

(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	431,449,359.25	99.05
	其中：股票	431,449,359.25	99.05
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	4,122,644.94	0.95
7	其他各项资产	14,579.14	0.00
8	合计	435,586,583.33	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	6,066,657.60	1.39
B	采矿业	6,169,683.98	1.42
C	制造业	252,352,713.33	57.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,364,767.52	1.69
E	建筑业	8,734,023.17	2.01
F	批发和零售业	12,354,904.51	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	1,360,847.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,104,200.85	11.97
J	金融业	29,936,199.10	6.88
K	房地产业	26,453,024.12	6.08
L	租赁和商务服务业	7,935,172.43	1.82
M	科学研究和技术服务业	851,004.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	6,385,929.72	1.47
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	2,110,375.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	9,399,059.32	2.16
S	综合	1,870,797.60	0.43
	合计	431,449,359.25	99.15

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	460,300	9,459,165.00	2.17
2	000651	格力电器	370,100	9,111,862.00	2.09
3	000333	美的集团	283,750	7,993,237.50	1.84
4	000001	平安银行	641,700	5,839,470.00	1.34
5	000725	京东方A	1,947,300	5,569,278.00	1.28
6	000858	五粮液	141,700	4,885,816.00	1.12

7	000776	广发证券	235,400	3,968,844.00	0.91
8	002450	康得新	199,110	3,804,992.10	0.87
9	002415	海康威视	154,250	3,672,692.50	0.84
10	002024	苏宁云商	304,600	3,487,670.00	0.80
11	000538	云南白药	40,200	3,061,230.00	0.70
12	002304	洋河股份	43,162	3,047,237.20	0.70
13	000166	申万宏源	486,360	3,039,750.00	0.70
14	300104	乐视网	82,600	2,957,080.00	0.68
15	000063	中兴通讯	182,500	2,910,875.00	0.67
16	300059	东方财富	164,180	2,779,567.40	0.64
17	001979	招商蛇口	163,301	2,676,503.39	0.62
18	000625	长安汽车	166,988	2,494,800.72	0.57
19	000100	TCL 集团	751,800	2,480,940.00	0.57
20	002673	西部证券	117,500	2,440,475.00	0.56
21	000783	长江证券	234,400	2,397,912.00	0.55
22	000503	海虹控股	56,100	2,359,005.00	0.54
23	000423	东阿阿胶	43,400	2,337,958.00	0.54
24	002142	宁波银行	137,260	2,284,006.40	0.52
25	002736	国信证券	141,300	2,197,215.00	0.50
26	002202	金风科技	126,500	2,164,415.00	0.50
27	002594	比亚迪	42,900	2,131,272.00	0.49
28	300070	碧水源	117,814	2,064,101.28	0.47
29	300072	三聚环保	44,578	2,063,515.62	0.47
30	002456	欧菲光	60,000	2,056,800.00	0.47
31	300017	网宿科技	37,200	1,994,292.00	0.46
32	000768	中航飞机	90,500	1,924,030.00	0.44
33	000839	中信国安	208,500	1,914,030.00	0.44
34	000728	国元证券	94,000	1,870,600.00	0.43
35	002230	科大讯飞	69,050	1,870,564.50	0.43
36	000338	潍柴动力	185,900	1,851,564.00	0.43
37	300024	机器人	86,266	1,844,367.08	0.42
38	002739	万达院线	33,700	1,822,159.00	0.42
39	000568	泸州老窖	55,200	1,821,600.00	0.42
40	000069	华侨城 A	259,500	1,803,525.00	0.41
41	002241	歌尔股份	67,700	1,795,404.00	0.41
42	000623	吉林敖东	57,000	1,766,430.00	0.41
43	002065	东华软件	72,600	1,691,580.00	0.39
44	000157	中联重科	370,100	1,680,254.00	0.39
45	002252	上海莱士	70,520	1,628,306.80	0.37

46	000413	东旭光电	144,400	1,625,944.00	0.37
47	300124	汇川技术	77,394	1,573,420.02	0.36
48	002236	大华股份	114,900	1,571,832.00	0.36
49	002466	天齐锂业	48,280	1,566,686.00	0.36
50	000895	双汇发展	74,400	1,557,192.00	0.36
51	300027	华谊兄弟	141,131	1,552,441.00	0.36
52	002007	华兰生物	42,900	1,533,675.00	0.35
53	000630	铜陵有色	495,100	1,524,908.00	0.35
54	000009	中国宝安	145,260	1,504,893.60	0.35
55	002008	大族激光	66,300	1,498,380.00	0.34
56	300136	信维通信	51,520	1,468,320.00	0.34
57	000540	中天城投	211,151	1,463,276.43	0.34
58	002465	海格通信	123,600	1,439,940.00	0.33
59	002475	立讯精密	67,750	1,405,812.50	0.32
60	000686	东北证券	113,720	1,405,579.20	0.32
61	000876	新希望	171,800	1,382,990.00	0.32
62	000826	启迪桑德	40,878	1,348,156.44	0.31
63	300408	三环集团	84,000	1,333,920.00	0.31
64	000060	中金岭南	119,200	1,329,080.00	0.31
65	300088	长信科技	83,300	1,316,140.00	0.30
66	000917	电广传媒	90,000	1,295,100.00	0.30
67	000656	金科股份	242,200	1,269,128.00	0.29
68	000963	华东医药	17,593	1,267,927.51	0.29
69	000559	万向钱潮	95,240	1,262,882.40	0.29
70	000887	中鼎股份	48,200	1,250,308.00	0.29
71	002405	四维图新	64,100	1,240,335.00	0.29
72	000748	长城信息	60,700	1,232,817.00	0.28
73	002085	万丰奥威	62,180	1,228,676.80	0.28
74	002310	东方园林	86,800	1,228,220.00	0.28
75	000661	长春高新	10,980	1,228,113.00	0.28
76	002183	怡亚通	112,800	1,225,008.00	0.28
77	300003	乐普医疗	68,126	1,221,499.18	0.28
78	000750	国海证券	170,550	1,188,733.50	0.27
79	000709	河钢股份	354,100	1,182,694.00	0.27
80	002129	中环股份	142,500	1,178,475.00	0.27
81	002385	大北农	164,950	1,171,145.00	0.27
82	000425	徐工机械	345,100	1,166,438.00	0.27
83	300168	万达信息	56,300	1,138,386.00	0.26
84	000547	航天发展	74,000	1,136,640.00	0.26

85	300315	掌趣科技	123,000	1,136,520.00	0.26
86	000415	渤海金控	158,700	1,134,705.00	0.26
87	002340	格林美	171,300	1,122,015.00	0.26
88	000402	金融街	107,700	1,109,310.00	0.25
89	000998	隆平高科	51,500	1,103,645.00	0.25
90	002500	山西证券	90,500	1,087,810.00	0.25
91	300156	神雾环保	42,700	1,067,927.00	0.25
92	300033	同花顺	15,500	1,066,090.00	0.24
93	300266	兴源环境	19,195	1,053,421.60	0.24
94	002407	多氟多	38,500	1,050,665.00	0.24
95	000983	西山煤电	123,800	1,047,348.00	0.24
96	002572	索菲亚	19,304	1,045,504.64	0.24
97	002075	沙钢股份	64,600	1,041,352.00	0.24
98	002400	省广股份	75,342	1,038,966.18	0.24
99	002074	国轩高科	33,400	1,035,066.00	0.24
100	300058	蓝色光标	101,619	1,033,465.23	0.24
101	002508	老板电器	28,000	1,030,400.00	0.24
102	002081	金螳螂	105,063	1,028,566.77	0.24
103	300115	长盈精密	39,380	1,026,242.80	0.24
104	000997	新大陆	52,350	1,017,160.50	0.23
105	002092	中泰化学	84,000	1,016,400.00	0.23
106	000050	深天马 A	53,400	1,004,988.00	0.23
107	000581	威孚高科	44,700	1,003,068.00	0.23
108	002460	赣锋锂业	37,500	994,125.00	0.23
109	000977	浪潮信息	46,000	975,200.00	0.22
110	300144	宋城演艺	46,273	968,956.62	0.22
111	000516	国际医学	120,400	951,160.00	0.22
112	000970	中科三环	70,600	942,510.00	0.22
113	000930	中粮生化	70,100	942,144.00	0.22
114	300498	温氏股份	26,700	940,374.00	0.22
115	000690	宝新能源	101,200	938,124.00	0.22
116	002030	达安基因	39,838	924,241.60	0.21
117	002176	江特电机	77,320	922,427.60	0.21
118	002168	深圳惠程	57,900	918,294.00	0.21
119	000039	中集集团	62,700	916,674.00	0.21
120	000400	许继电气	50,000	907,500.00	0.21
121	000792	盐湖股份	47,425	904,394.75	0.21
122	002426	胜利精密	108,700	898,949.00	0.21
123	002292	奥飞娱乐	39,200	889,840.00	0.20

124	002038	双鹭药业	33,267	888,561.57	0.20
125	000712	锦龙股份	37,900	888,376.00	0.20
126	002271	东方雨虹	40,884	886,773.96	0.20
127	002470	金正大	112,156	886,032.40	0.20
128	002701	奥瑞金	102,100	882,144.00	0.20
129	300253	卫宁健康	44,980	881,158.20	0.20
130	000778	新兴铸管	169,500	876,315.00	0.20
131	002422	科伦药业	54,200	873,704.00	0.20
132	002049	紫光国芯	26,200	863,028.00	0.20
133	000598	兴蓉环境	148,400	854,784.00	0.20
134	002573	清新环境	48,900	854,283.00	0.20
135	002004	华邦健康	93,600	848,952.00	0.20
136	002439	启明星辰	40,700	846,153.00	0.19
137	000738	中航动控	34,100	843,634.00	0.19
138	000697	炼石有色	35,800	841,658.00	0.19
139	000046	泛海控股	90,300	838,887.00	0.19
140	000566	海南海药	65,326	830,293.46	0.19
141	002221	东华能源	65,900	816,501.00	0.19
142	000758	中色股份	100,400	802,196.00	0.18
143	002179	中航光电	22,100	802,009.00	0.18
144	300142	沃森生物	73,300	798,970.00	0.18
145	000961	中南建设	76,550	796,120.00	0.18
146	000988	华工科技	50,800	795,020.00	0.18
147	300015	爱尔眼科	26,400	789,360.00	0.18
148	002311	海大集团	52,280	786,814.00	0.18
149	000878	云南铜业	66,500	785,365.00	0.18
150	002353	杰瑞股份	38,400	779,520.00	0.18
151	300002	神州泰岳	83,718	773,554.32	0.18
152	002013	中航机电	42,250	772,752.50	0.18
153	000806	银河生物	48,758	772,326.72	0.18
154	002018	华信国际	75,610	768,953.70	0.18
155	300113	顺网科技	28,570	768,247.30	0.18
156	002001	新 和 成	39,150	767,340.00	0.18
157	300055	万邦达	46,790	766,420.20	0.18
158	002665	首航节能	87,310	764,835.60	0.18
159	002294	信立泰	26,000	760,240.00	0.17
160	000999	华润三九	30,682	758,765.86	0.17
161	000960	锡业股份	57,821	758,611.52	0.17
162	000031	中粮地产	85,000	758,200.00	0.17

163	002223	鱼跃医疗	24,420	757,508.40	0.17
164	300077	国民技术	46,500	755,625.00	0.17
165	002146	荣盛发展	95,700	751,245.00	0.17
166	300244	迪安诊断	23,472	751,104.00	0.17
167	000727	华东科技	222,800	750,836.00	0.17
168	000718	苏宁环球	86,809	749,161.67	0.17
169	002051	中工国际	32,580	746,733.60	0.17
170	000671	阳光城	134,000	746,380.00	0.17
171	300431	暴风集团	16,200	745,200.00	0.17
172	300418	昆仑万维	34,300	740,880.00	0.17
173	002152	广电运通	55,600	738,368.00	0.17
174	000078	海王生物	117,050	737,415.00	0.17
175	002583	海能达	55,820	737,382.20	0.17
176	000939	凯迪生态	57,194	736,086.78	0.17
177	000883	湖北能源	160,500	735,090.00	0.17
178	002131	利欧股份	45,900	732,105.00	0.17
179	000518	四环生物	82,400	731,712.00	0.17
180	002191	劲嘉股份	69,900	727,659.00	0.17
181	000488	晨鸣纸业	70,000	725,200.00	0.17
182	000061	农产品	58,532	724,040.84	0.17
183	000012	南玻A	63,700	722,358.00	0.17
184	002048	宁波华翔	32,500	719,550.00	0.17
185	300207	欣旺达	51,700	718,630.00	0.17
186	002491	通鼎互联	45,800	711,732.00	0.16
187	300079	数码视讯	99,400	711,704.00	0.16
188	000800	一汽轿车	65,200	708,724.00	0.16
189	002501	利源精制	57,700	707,979.00	0.16
190	002280	联络互动	50,650	707,580.50	0.16
191	002410	广联达	48,400	706,640.00	0.16
192	000066	长城电脑	56,800	706,592.00	0.16
193	300251	光线传媒	72,380	706,428.80	0.16
194	000825	太钢不锈	179,200	706,048.00	0.16
195	300203	聚光科技	23,100	705,705.00	0.16
196	300134	大富科技	27,800	705,008.00	0.16
197	000006	深振业A	74,227	701,445.15	0.16
198	300273	和佳股份	40,900	697,754.00	0.16
199	300324	旋极信息	36,000	695,880.00	0.16
200	002138	顺络电子	40,200	695,862.00	0.16
201	002602	世纪华通	14,839	695,800.71	0.16

202	002250	联化科技	43,000	695,740.00	0.16
203	002299	圣农发展	32,700	693,894.00	0.16
204	002276	万马股份	46,100	692,883.00	0.16
205	000729	燕京啤酒	99,600	692,220.00	0.16
206	300146	汤臣倍健	57,700	688,938.00	0.16
207	000786	北新建材	66,800	687,372.00	0.16
208	002108	沧州明珠	33,660	685,654.20	0.16
209	000979	中弘股份	259,500	685,080.00	0.16
210	002050	三花智控	61,300	676,752.00	0.16
211	000028	国药一致	10,100	675,690.00	0.16
212	000975	银泰资源	43,001	672,535.64	0.15
213	000563	陕国投 A	89,100	666,468.00	0.15
214	002343	慈文传媒	14,700	663,999.00	0.15
215	300383	光环新网	26,600	663,936.00	0.15
216	002273	水晶光电	33,350	663,665.00	0.15
217	000627	天茂集团	86,400	660,960.00	0.15
218	300267	尔康制药	50,600	660,330.00	0.15
219	000860	顺鑫农业	30,000	660,000.00	0.15
220	300216	千山药机	19,400	658,242.00	0.15
221	002022	科华生物	32,900	658,000.00	0.15
222	002266	浙富控股	113,040	651,110.40	0.15
223	002477	雏鹰农牧	129,600	650,592.00	0.15
224	300367	东方网力	32,462	650,538.48	0.15
225	000543	皖能电力	85,350	649,513.50	0.15
226	000938	紫光股份	11,300	648,507.00	0.15
227	300090	盛运环保	55,700	646,120.00	0.15
228	002544	杰赛科技	22,923	645,053.22	0.15
229	002155	湖南黄金	56,200	643,490.00	0.15
230	002384	东山精密	32,700	641,247.00	0.15
231	002308	威创股份	43,500	641,190.00	0.15
232	300068	南都电源	32,800	632,056.00	0.15
233	002153	石基信息	25,892	630,988.04	0.15
234	002424	贵州百灵	33,200	628,808.00	0.14
235	002185	华天科技	51,990	628,039.20	0.14
236	300287	飞利信	52,700	627,130.00	0.14
237	300271	华宇软件	35,831	625,250.95	0.14
238	002195	二三四五	55,200	624,864.00	0.14
239	000027	深圳能源	90,700	623,109.00	0.14
240	000513	丽珠集团	10,450	621,775.00	0.14

241	000667	美好置业	168,200	620,658.00	0.14
242	300026	红日药业	113,700	617,391.00	0.14
243	002078	太阳纸业	92,400	617,232.00	0.14
244	000592	平潭发展	91,000	615,160.00	0.14
245	002027	分众传媒	43,100	615,037.00	0.14
246	002440	闰土股份	37,600	614,384.00	0.14
247	300133	华策影视	54,084	613,853.40	0.14
248	000829	天音控股	54,400	613,632.00	0.14
249	000601	韶能股份	71,400	613,326.00	0.14
250	000410	沈阳机床	45,900	613,224.00	0.14
251	002268	卫士通	19,500	612,690.00	0.14
252	300182	捷成股份	58,834	606,578.54	0.14
253	002489	浙江永强	80,100	606,357.00	0.14
254	002281	光迅科技	7,700	604,450.00	0.14
255	000882	华联股份	132,100	603,697.00	0.14
256	002714	牧原股份	25,900	602,952.00	0.14
257	002640	跨境通	32,900	602,070.00	0.14
258	000089	深圳机场	74,400	595,200.00	0.14
259	000901	航天科技	18,100	594,766.00	0.14
260	000875	吉电股份	90,500	594,585.00	0.14
261	002444	巨星科技	38,000	592,800.00	0.14
262	000937	冀中能源	87,690	591,030.60	0.14
263	002023	海特高新	42,500	588,200.00	0.14
264	300166	东方国信	28,200	586,278.00	0.13
265	300078	思创医惠	22,600	585,566.00	0.13
266	002595	豪迈科技	27,800	585,190.00	0.13
267	300170	汉得信息	49,500	584,595.00	0.13
268	300199	翰宇药业	32,400	582,552.00	0.13
269	002217	合力泰	32,500	581,750.00	0.13
270	300098	高新兴	36,700	581,328.00	0.13
271	300274	阳光电源	54,980	579,489.20	0.13
272	300197	铁汉生态	45,630	578,588.40	0.13
273	000926	福星股份	45,400	578,396.00	0.13
274	002657	中科金财	13,400	578,344.00	0.13
275	002630	华西能源	46,900	578,277.00	0.13
276	300291	华录百纳	25,800	574,824.00	0.13
277	300001	特锐德	33,100	573,954.00	0.13
278	300159	新研股份	42,200	573,076.00	0.13
279	002025	航天电器	22,670	571,284.00	0.13

280	000519	江南红箭	38,279	570,357.10	0.13
281	002522	浙江众成	31,700	570,283.00	0.13
282	300347	泰格医药	21,100	569,911.00	0.13
283	002312	三泰控股	64,950	568,312.50	0.13
284	002668	奥马电器	8,000	567,600.00	0.13
285	002375	亚厦股份	53,300	563,914.00	0.13
286	300010	立思辰	33,861	562,769.82	0.13
287	002019	亿帆医药	36,700	561,143.00	0.13
288	002073	软控股份	49,400	560,690.00	0.13
289	002672	东江环保	31,750	558,800.00	0.13
290	000021	深科技	59,066	556,992.38	0.13
291	002041	登海种业	29,500	556,960.00	0.13
292	000898	鞍钢股份	110,355	556,189.20	0.13
293	000762	西藏矿业	32,658	556,165.74	0.13
294	002570	贝因美	42,300	554,976.00	0.13
295	300212	易华录	16,300	554,200.00	0.13
296	002421	达实智能	84,170	553,838.60	0.13
297	001696	宗申动力	58,900	553,660.00	0.13
298	002104	恒宝股份	46,900	552,951.00	0.13
299	002055	得润电子	23,300	552,443.00	0.13
300	000558	莱茵体育	37,400	551,650.00	0.13
301	002368	太极股份	18,008	551,224.88	0.13
302	000816	智慧农业	86,300	548,868.00	0.13
303	002390	信邦制药	55,300	546,917.00	0.13
304	000807	云铝股份	81,600	546,720.00	0.13
305	002047	宝鹰股份	58,400	546,040.00	0.13
306	300014	亿纬锂能	18,600	543,120.00	0.12
307	002244	滨江集团	77,800	543,044.00	0.12
308	000848	承德露露	48,500	542,715.00	0.12
309	002396	星网锐捷	27,500	541,750.00	0.12
310	000156	华数传媒	30,200	540,882.00	0.12
311	002303	美盈森	52,500	539,700.00	0.12
312	000902	新洋丰	47,902	539,376.52	0.12
313	300101	振芯科技	29,000	537,660.00	0.12
314	002326	永太科技	32,800	534,968.00	0.12
315	000401	冀东水泥	44,900	534,310.00	0.12
316	300020	银江股份	33,772	532,922.16	0.12
317	002002	鸿达兴业	72,561	532,597.74	0.12
318	300012	华测检测	46,000	531,300.00	0.12

319	002052	同洲电子	47,110	527,632.00	0.12
320	002603	以岭药业	30,403	524,147.72	0.12
321	000751	锌业股份	92,000	523,480.00	0.12
322	002067	景兴纸业	77,999	521,033.32	0.12
323	002099	海翔药业	61,400	520,672.00	0.12
324	000777	中核科技	23,200	519,216.00	0.12
325	000620	新华联	61,201	518,984.48	0.12
326	002028	思源电气	39,360	518,764.80	0.12
327	300122	智飞生物	31,400	517,158.00	0.12
328	002589	瑞康医药	15,900	515,955.00	0.12
329	000616	海航投资	98,700	515,214.00	0.12
330	002366	台海核电	9,500	509,390.00	0.12
331	002285	世联行	66,940	508,744.00	0.12
332	000666	经纬纺机	23,800	508,606.00	0.12
333	002429	兆驰股份	51,000	507,960.00	0.12
334	002161	远望谷	43,800	505,014.00	0.12
335	002358	森源电气	26,300	504,434.00	0.12
336	000587	金洲慈航	33,800	502,944.00	0.12
337	002224	三力士	33,400	502,336.00	0.12
338	000687	华讯方舟	32,500	499,200.00	0.11
339	300053	欧比特	35,200	498,784.00	0.11
340	002437	誉衡药业	60,100	497,027.00	0.11
341	300238	冠昊生物	14,900	496,915.00	0.11
342	002325	洪涛股份	61,900	495,819.00	0.11
343	002481	双塔食品	54,600	495,222.00	0.11
344	000685	中山公用	44,400	494,172.00	0.11
345	002089	新海宜	34,700	492,393.00	0.11
346	000572	海马汽车	91,800	492,048.00	0.11
347	002399	海普瑞	26,980	491,575.60	0.11
348	300433	蓝思科技	17,800	491,458.00	0.11
349	300009	安科生物	23,000	490,360.00	0.11
350	000650	仁和药业	69,500	489,975.00	0.11
351	300496	中科创达	9,300	486,204.00	0.11
352	300096	易联众	31,100	484,849.00	0.11
353	300257	开山股份	27,800	477,048.00	0.11
354	002123	梦网荣信	31,600	474,000.00	0.11
355	300202	聚龙股份	19,200	472,320.00	0.11
356	002063	远光软件	35,874	471,384.36	0.11
357	002106	莱宝高科	41,925	471,237.00	0.11

358	002373	千方科技	34,100	470,580.00	0.11
359	002467	二六三	44,600	469,192.00	0.11
360	000652	泰达股份	84,900	468,648.00	0.11
361	002284	亚太股份	33,300	468,531.00	0.11
362	000830	鲁西化工	83,800	468,442.00	0.11
363	002174	游族网络	17,700	468,165.00	0.11
364	002237	恒邦股份	40,700	468,050.00	0.11
365	000801	四川九洲	43,800	465,594.00	0.11
366	000969	安泰科技	44,000	463,760.00	0.11
367	002005	德豪润达	80,500	462,875.00	0.11
368	000851	高鸿股份	39,500	460,570.00	0.11
369	002505	大康农业	130,030	460,306.20	0.11
370	002482	广田集团	49,600	458,800.00	0.11
371	002190	成飞集成	14,300	457,314.00	0.11
372	002043	兔宝宝	39,450	456,436.50	0.10
373	002428	云南锗业	36,000	456,120.00	0.10
374	000733	振华科技	25,400	453,390.00	0.10
375	000897	津滨发展	105,800	452,824.00	0.10
376	002151	北斗星通	14,150	451,385.00	0.10
377	000528	柳工	61,600	450,296.00	0.10
378	002474	榕基软件	33,200	450,192.00	0.10
379	000541	佛山照明	45,750	450,180.00	0.10
380	002031	巨轮智能	131,900	449,779.00	0.10
381	000973	佛塑科技	59,900	449,250.00	0.10
382	002555	三七互娱	27,300	447,720.00	0.10
383	002261	拓维信息	37,500	447,000.00	0.10
384	300147	香雪制药	34,560	445,824.00	0.10
385	300085	银之杰	21,277	444,689.30	0.10
386	002130	沃尔核材	31,400	443,368.00	0.10
387	000735	罗牛山	61,840	442,774.40	0.10
388	002010	传化智联	23,500	441,800.00	0.10
389	002512	达华智能	26,900	439,277.00	0.10
390	300011	鼎汉技术	21,200	439,264.00	0.10
391	002269	美邦服饰	87,600	438,876.00	0.10
392	000600	建投能源	49,300	437,784.00	0.10
393	002121	科陆电子	49,600	437,472.00	0.10
394	002056	横店东磁	31,400	436,774.00	0.10
395	300359	全通教育	22,000	435,380.00	0.10
396	300043	星辉娱乐	42,900	435,006.00	0.10

397	300364	中文在线	11,000	434,720.00	0.10
398	002588	史丹利	38,300	434,705.00	0.10
399	000158	常山股份	34,600	432,500.00	0.10
400	002550	千红制药	59,900	432,478.00	0.10
401	002431	棕榈股份	46,950	430,062.00	0.10
402	002433	太安堂	39,500	428,180.00	0.10
403	002344	海宁皮城	37,735	427,160.20	0.10
404	002339	积成电子	22,400	426,496.00	0.10
405	002318	久立特材	42,450	424,500.00	0.10
406	002463	沪电股份	88,000	420,640.00	0.10
407	002773	康弘药业	7,400	420,246.00	0.10
408	002563	森马服饰	40,800	419,016.00	0.10
409	300352	北信源	21,530	417,897.30	0.10
410	002663	普邦股份	68,600	416,402.00	0.10
411	002249	大洋电机	48,000	414,240.00	0.10
412	000090	天健集团	42,520	410,743.20	0.09
413	002329	皇氏集团	29,000	409,480.00	0.09
414	002071	长城影视	30,000	409,200.00	0.09
415	000062	深圳华强	14,400	409,104.00	0.09
416	300039	上海凯宝	39,940	408,586.20	0.09
417	002471	中超控股	67,400	408,444.00	0.09
418	002215	诺普信	36,863	408,442.04	0.09
419	002690	美亚光电	19,300	408,388.00	0.09
420	002642	荣之联	20,300	408,030.00	0.09
421	002376	新北洋	32,800	406,720.00	0.09
422	002154	报喜鸟	75,000	406,500.00	0.09
423	002413	雷科防务	34,700	401,826.00	0.09
424	002128	露天煤业	46,700	401,620.00	0.09
425	002721	金一文化	24,000	400,320.00	0.09
426	002517	恺英网络	11,900	399,364.00	0.09
427	300005	探路者	23,800	397,222.00	0.09
428	300336	新文化	20,030	393,589.50	0.09
429	002242	九阳股份	21,800	393,054.00	0.09
430	002699	美盛文化	11,600	392,080.00	0.09
431	000996	中国中期	16,100	389,620.00	0.09
432	002011	盾安环境	40,900	389,368.00	0.09
433	000088	盐田港	54,500	388,585.00	0.09
434	002170	芭田股份	41,801	388,331.29	0.09
435	000049	德赛电池	9,200	386,860.00	0.09

436	002649	博彦科技	9,900	385,110.00	0.09
437	300222	科大智能	19,100	382,000.00	0.09
438	002488	金固股份	23,000	381,800.00	0.09
439	000861	海印股份	78,250	379,512.50	0.09
440	000099	中信海直	32,200	377,062.00	0.09
441	300075	数字政通	20,100	374,664.00	0.09
442	002625	龙生股份	10,000	374,600.00	0.09
443	000539	粤电力 A	70,307	374,033.24	0.09
444	000555	神州信息	17,600	373,648.00	0.09
445	002498	汉缆股份	86,800	373,240.00	0.09
446	002177	御银股份	48,600	372,276.00	0.09
447	300032	金龙机电	23,100	371,679.00	0.09
448	002029	七匹狼	36,000	367,560.00	0.08
449	300228	富瑞特装	28,640	366,305.60	0.08
450	000931	中关村	43,200	365,904.00	0.08
451	002556	辉隆股份	35,050	364,169.50	0.08
452	000987	越秀金控	24,750	358,627.50	0.08
453	002414	高德红外	15,739	358,534.42	0.08
454	002551	尚荣医疗	17,913	356,647.83	0.08
455	002095	生意宝	8,840	353,953.60	0.08
456	002229	鸿博股份	15,000	353,100.00	0.08
457	000732	泰禾集团	19,900	352,031.00	0.08
458	300226	上海钢联	8,700	351,654.00	0.08
459	300178	腾邦国际	21,632	349,140.48	0.08
460	002298	中电鑫龙	25,200	348,012.00	0.08
461	300083	劲胜精密	47,300	347,655.00	0.08
462	002093	国脉科技	31,100	344,277.00	0.08
463	002751	易尚展示	7,400	343,656.00	0.08
464	002143	印纪传媒	10,500	338,205.00	0.08
465	002416	爱施德	22,900	337,317.00	0.08
466	300339	润和软件	11,000	336,600.00	0.08
467	002197	证通电子	20,600	335,986.00	0.08
468	000693	ST 华泽	26,800	335,000.00	0.08
469	002681	奋达科技	25,700	332,301.00	0.08
470	300333	兆日科技	19,467	330,354.99	0.08
471	002445	中南文化	22,000	330,220.00	0.08
472	000681	视觉中国	17,100	325,926.00	0.07
473	002178	延华智能	34,600	319,704.00	0.07
474	000869	张裕 A	8,800	316,800.00	0.07

475	300152	科融环境	42,800	315,864.00	0.07
476	000767	漳泽电力	81,600	314,160.00	0.07
477	002658	雪迪龙	18,200	313,040.00	0.07
478	300369	绿盟科技	9,100	309,127.00	0.07
479	300413	快乐购	13,400	307,932.00	0.07
480	300052	中青宝	12,800	305,920.00	0.07
481	002527	新时达	22,650	303,736.50	0.07
482	002568	百润股份	15,000	303,600.00	0.07
483	002493	荣盛石化	19,400	299,148.00	0.07
484	300188	美亚柏科	13,683	292,679.37	0.07
485	300368	汇金股份	13,400	292,388.00	0.07
486	002036	联创电子	15,200	291,232.00	0.07
487	300171	东富龙	19,200	285,888.00	0.07
488	300191	潜能恒信	8,100	278,640.00	0.06
489	002432	九安医疗	17,900	277,987.00	0.06
490	300295	三六五网	9,400	271,566.00	0.06
491	300205	天喻信息	18,700	268,158.00	0.06
492	002698	博实股份	17,190	267,648.30	0.06
493	002717	岭南园林	10,300	267,594.00	0.06
494	300074	华平股份	28,900	265,880.00	0.06
495	300229	拓尔思	15,800	260,858.00	0.06
496	002181	粤传媒	33,100	260,828.00	0.06
497	300288	朗玛信息	9,000	246,150.00	0.06
498	002577	雷柏科技	7,400	224,516.00	0.05
499	002653	海思科	14,016	219,070.08	0.05
500	002741	光华科技	10,500	204,960.00	0.05
501	002835	同为股份	1,020	21,940.20	0.01

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	002739	万达院线	2,682,478.00	0.35
2	002460	赣锋锂业	1,673,128.00	0.22
3	000748	长城信息	1,646,170.00	0.22
4	300431	暴风集团	1,410,715.00	0.18
5	002572	索菲亚	1,304,889.96	0.17

6	300418	昆仑万维	1,282,339.00	0.17
7	300383	光环新网	1,272,029.00	0.17
8	002018	华信国际	1,220,154.00	0.16
9	002673	西部证券	1,149,413.50	0.15
10	000333	美的集团	1,045,319.00	0.14
11	002224	三力士	1,024,024.00	0.13
12	300014	亿纬锂能	1,020,789.00	0.13
13	300078	思创医惠	981,863.56	0.13
14	002027	分众传媒	977,193.00	0.13
15	002031	巨轮智能	964,168.00	0.13
16	000166	申万宏源	942,260.00	0.12
17	300266	兴源环境	941,658.25	0.12
18	002075	沙钢股份	915,997.00	0.12
19	002074	国轩高科	914,860.00	0.12
20	000066	长城电脑	909,621.00	0.12

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	000002	万科A	10,401,902.00	1.36
2	000651	格力电器	1,935,476.00	0.25
3	300104	乐视网	1,555,053.00	0.20
4	002219	恒康医疗	1,550,322.23	0.20
5	000629	*ST 钒钛	1,105,060.00	0.14
6	000402	金融街	1,041,141.00	0.14
7	000831	*ST 五稀	941,719.00	0.12
8	000426	兴业矿业	820,870.00	0.11
9	002024	苏宁云商	767,747.00	0.10
10	000553	沙隆达A	762,136.00	0.10
11	000511	*ST 烯碳	761,582.00	0.10
12	000876	新希望	757,047.00	0.10
13	000061	农产品	744,517.00	0.10
14	300054	鼎龙股份	740,452.00	0.10
15	002638	勤上光电	716,257.00	0.09

16	000783	长江证券	676,125.44	0.09
17	002681	奋达科技	671,748.00	0.09
18	300111	向日葵	635,000.00	0.08
19	300183	东软载波	608,083.00	0.08
20	000596	古井贡酒	592,495.55	0.08

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	78,598,728.93
卖出股票收入（成交）总额	82,455,789.84

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体是否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，于 2016 年 11 月 26 日收到证监会行政处罚通知书。本基金依据法规及基金合同的要求，严格根据标的指数的成分股及其权重进行跟踪操作。

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	13,736.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	842.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,579.14

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
10,663	3,820.25	1,020,134.00	2.50%	39,715,208.00	97.50%

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	张小丽	943,648.00	2.32%
2	信诚人寿保险有限公司一分红账户	536,768.00	1.32%
3	许贤明	204,382.00	0.50%
4	常州对外贸易有限公司	200,360.00	0.49%
5	林莹	197,096.00	0.48%
6	戴济民	196,967.00	0.48%
7	贺雅宁	196,965.00	0.48%
8	寇胜利	196,694.00	0.48%
9	吕君	180,000.00	0.44%
10	何凤珍	166,424.00	0.41%

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	58,135,342.00
本报告期基金总申购份额	300,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	17,700,000.00
本报告期末基金份额总额	40,735,342.00

§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、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2016 年 6 月 25 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十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

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、基金托管业务的重大诉讼事项。

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 75,000.00 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

1、报告期内基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“深圳证监局”）《关于对大成基金管理有限公司采取责令整改并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行

整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 6 个月，暂停受理新设子公司业务申请 1 年，对相关责任人采取行政监管措施。公司高度重视，制定并落实相关整改措施，并及时向深圳证监局提交整改报告。目前公司已完成相关整改工作。

2、报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
光大证券	2	160,643,071.97	100.00%	146,398.56	100.00%	-
广发证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	3	-	0.00%	-	0.00%	新增
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西藏东财证 券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中原证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：爱建证券、东方证券、中原证券、中金公司、广发证券、东吴

证券、万和证券。

本报告期内本基金退租交易单元：无。

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
光大证券	208,584.00	100.00%	-	0.00%	-	0.00%

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 10 月 24 日
2	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 25 日
3	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 25 日
4	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 7 月 20 日
5	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 7 月 20 日
6	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 7 月 20 日
7	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 14 日
8	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
9	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
10	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
11	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
12	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2015 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
13	大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2015 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
14	关于再次提请投资者及时更新已过期身份	中国证监会指定报刊	2016 年 12 月 22 日

	证件或者身份证明文件的公告	及本公司网站	
15	大成基金管理有限公司关于撤销上海理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 9 月 21 日
16	大成基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 9 月 20 日
17	大成基金管理有限公司关于撤销福州分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 6 日
18	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联-民生银行支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 8 月 5 日
19	关于调整直销网上交易系统通联支付交通银行渠道认申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 7 月 19 日
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	2016 年 6 月 25 日
21	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 18 日
22	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 29 日
23	大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
24	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
25	关于网上直销端建设银行进行系统维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 15 日
26	大成基金管理有限公司关于网上直销端通联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 14 日
27	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
28	大成基金管理有限公司关于网上直销端中国银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
29	大成基金管理有限公司关于网上直销端民生银行渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 25 日
30	大成基金管理有限公司关于网上直销端暂停申购交易业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 3 日
31	大成基金管理有限公司关于网上直销端银联支付渠道维护暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 26 日
32	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停部分服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 22 日
33	大成基金管理有限公司关于网上交易通联系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 19 日
34	大成基金管理有限公司关于网上交易 PC 端银联支付渠道升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 15 日

35	大成基金管理有限公司 关于网上交易系统升级暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 14 日
36	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
37	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 6 日
38	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 5 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改<公司章程>的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。

3、基金管理人于 2017 年 2 月 18 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二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

§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

2017年3月25日