

大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金
2015 年年度报告摘要
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,507,615.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013-10-09

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金标的指数为中证 500 深市价格指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896

	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 信息披露方式

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 1 号中国银行股份有限公司托管业务部

§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	2014 年	2013 年 9 月 12 日 (基金合同生效日)- 2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,530,129.48	5,729,668.89	3,177,459.71
本期利润	952,383.02	6,423,634.37	2,584,898.31
加权平均基金份额本期利润	0.0973	0.5141	0.0201
本期基金份额净值增长率	46.00%	30.80%	-2.54%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	1.0163	0.3117	-0.0290
期末基金资产净值	42,855,510.49	5,220,217.34	51,588,147.84
期末基金份额净值	2.197	1.448	1.107

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

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

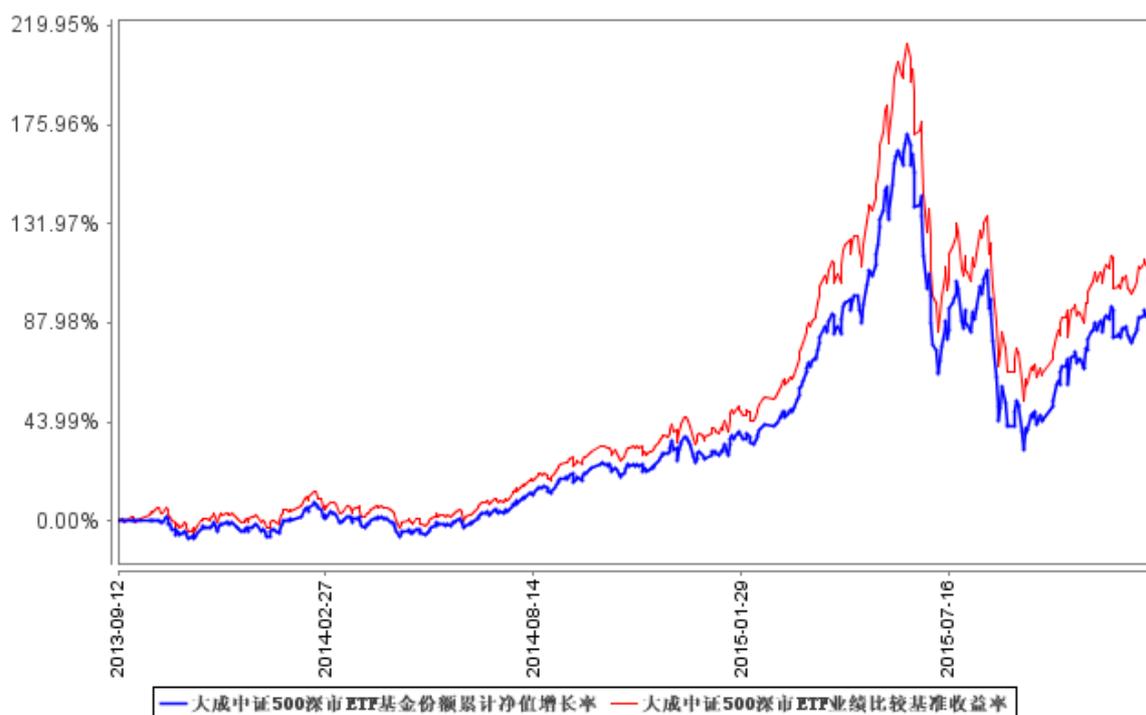
3.2 基金净值表现

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	28.93%	2.15%	26.19%	2.11%	2.74%	0.04%
过去六个月	-11.38%	3.25%	-12.62%	3.09%	1.24%	0.16%

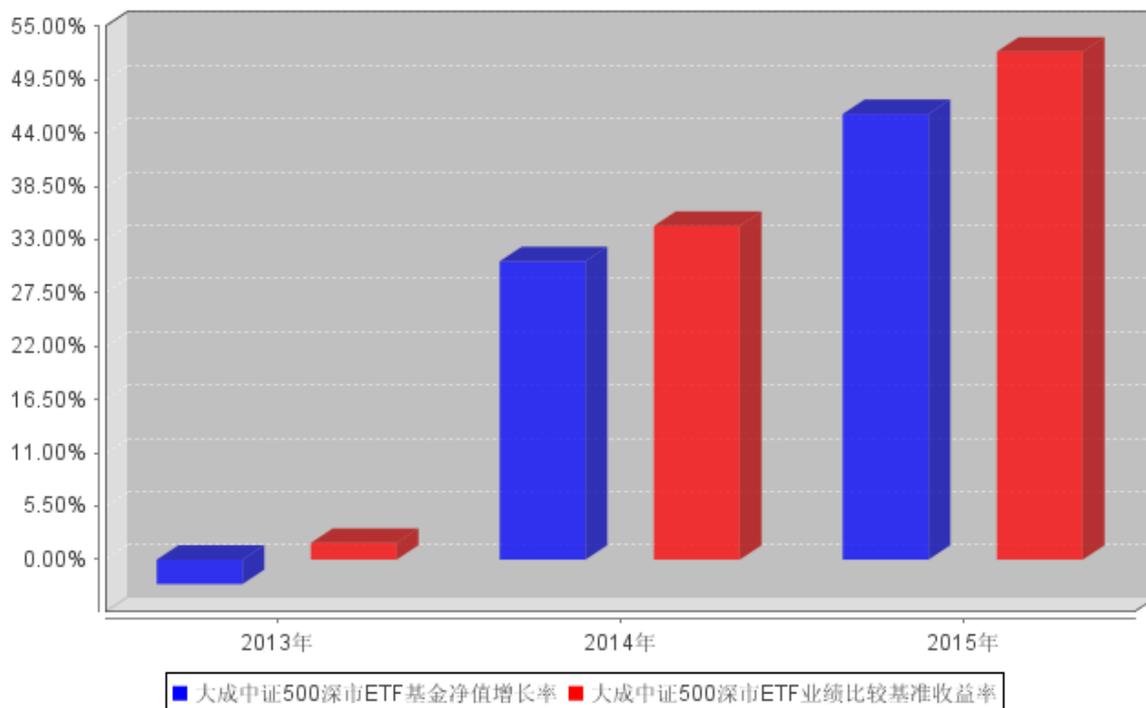
过去一年	46.00%	2.78%	52.43%	2.73%	-6.43%	0.05%
自基金合同生效起至今	86.11%	2.03%	108.45%	2.04%	-22.34%	-0.01%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

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：2013 年净值增长率表现期间为 2013 年 9 月 12 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2013 年 9 月 12 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§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		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 5 月 23 日	-	6 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013 年 3 月 25 日至 2015 年 1 月 14 日担任大成优选股票型证

					券投资基金 (LOF) 和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理, 2015 年 7 月 22 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍: 中国
湛湛先生	本基金基金经理	2013 年 9 月 12 日	2015 年 5 月 22 日	6 年	金融工程硕士。2009 年加入大成基金管理有限公司, 历任金融工程师、数量投资分析师。2013 年 1 月 4 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2013 年 9 月 12 日至 2015 年 5 月 22 日担任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2014 年 9 月 12 日至 2015 年 5 月 22 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍: 中国
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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 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 A 股剧烈震荡，6 月中旬前在国内货币政策宽松，股市投资者不断加大杠杆的推动下，上证综指时隔七年后再次站上 5000 点。6 月 15 日之后两个多月，监管层控风险去杠杆，人民币意外大幅贬值，上证综指暴跌近 45%，半数以上上市公司股价腰斩。9 月后，小市值题材股大幅反弹，带动指数小幅上涨。纵观全年，成长股、题材股相对于大盘蓝筹股超额收益显著，创业板指数大幅上涨 84.4%，沪深 300 指数仅微涨 5.6%。

2015 年国内经济依然缓慢探底，分结构看受益于国内经济增长转型政策，第三产业增速有回升趋势，这也是新兴行业股票表现较好的原因。上半年货币政策宽松明显，下半年受人民币汇率波动影响，宽松政策不达预期，股市表现也远逊于上半年。

报告期内本基金基本保持高仓位运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 2.197 元，本报告期基金份额净值增长率为 46%，同期业绩比较基准收益率为 52.43%，低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，经济依然处于回落阶段，经济增速中枢可能继续下台阶。政府可能加大基建投资，继续推出房地产去库存政策以对冲传统产业去产能带来的投资下滑，但预计投资增长仍将回落；消费在收入增长放缓的情况下，增速仍将回落；进出口在人民币贬值、美国经济复苏的情况下有望逐渐好转。虽然国内通胀仍较低，但在人民币汇率贬值压力下，央行的货币政策空间不大，预计货币宽松政策力度将远小于 2015 年。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

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

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

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

另有规定的除外) 的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内, 曾于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形以及连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人的情形。本基金已按法律法规相关规定向中国证监会报告清盘解决方案, 本基金管理人后续将根据法规规定对该事项的最新进展进行信息披露。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容, 应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,271,654.11	271,826.55
结算备付金	7,921.48	-
存出保证金	3,875.92	394.87
交易性金融资产	42,148,281.92	5,126,061.64
其中：股票投资	42,148,281.92	5,126,061.64
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	316.77	362.76
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	43,432,050.20	5,398,645.82
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	368,720.72	3,012.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	18,198.75	3,089.40
应付托管费	3,639.75	617.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	15,980.49	1,709.20

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	170,000.00	170,000.00
负债合计	576,539.71	178,428.48
所有者权益：		
实收基金	23,029,486.80	4,096,241.51
未分配利润	19,826,023.69	1,123,975.83
所有者权益合计	42,855,510.49	5,220,217.34
负债和所有者权益总计	43,432,050.20	5,398,645.82

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 2.197 元，基金份额总额 19,507,615.00 份。

7.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	1,695,160.66	6,910,219.26
1.利息收入	14,933.99	6,843.93
其中：存款利息收入	14,933.99	6,840.47
债券利息收入	-	3.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,284,225.91	6,205,045.39
其中：股票投资收益	2,253,141.14	6,104,918.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	239.12
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	31,084.77	99,887.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-577,746.46	693,965.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-26,252.78	4,364.46
减：二、费用	742,777.64	486,584.89
1. 管理人报酬	99,457.58	74,573.79

2. 托管费	19,891.54	14,914.75
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	43,218.52	16,902.35
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	580,210.00	380,194.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	952,383.02	6,423,634.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	952,383.02	6,423,634.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	4,096,241.51	1,123,975.83	5,220,217.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	952,383.02	952,383.02
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）	18,933,245.29	17,749,664.84	36,682,910.13
其中：1.基金申购款	30,658,628.88	29,200,830.05	59,859,458.93
2.基金赎回款	-11,725,383.59	-11,451,165.21	-23,176,548.80
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）	23,029,486.80	19,826,023.69	42,855,510.49
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	52,940,196.69	-1,352,048.85	51,588,147.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,423,634.37	6,423,634.37
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)	-48,843,955.18	-3,947,609.69	-52,791,564.87
其中：1.基金申购款	128,357,370.65	15,434,349.97	143,791,720.62
2.基金赎回款	-177,201,325.83	-19,381,959.66	-196,583,285.49
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)	4,096,241.51	1,123,975.83	5,220,217.34

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>范瑛</u>
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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

7.4.2 税项

7.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.2.2 营业税、企业所得税

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。

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。

证券投资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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.3 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金申赎代办券商
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：(1)于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

(2)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。

(3)以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 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 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-	-	21.39	0.00%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.4 回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

7.4.4.1.1 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 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	-	-	-	-
关联方名称	上期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	0.02	0.00%	-	-

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	99,457.58	74,573.79
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

（2）于 2015 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 18,198.75 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 3,089.40 元）。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,891.54	14,914.75

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

（2）于 2015 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 3,639.75 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 617.88 元）。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额(注)	17,000,000.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额(注)	-	-
期末持有的基金份额	17,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份 额比例	87.15%	-

注：基金管理人赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

7.4.4.5 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国银行	1,271,654.11	13,790.84	271,826.55	5,537.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率及相关协议利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.5.2 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
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	200	3,918.36	8,816.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项	34.88	2016年3月10日	31.39	2,300	73,323.60	80,224.00	-
002219	恒康医疗	2015年7月8日	重大事项	14.90	-	-	2,500	34,515.79	37,250.00	-
002174	游族网络	2015年7月23日	重大事项	89.53	2016年2月15日	80.58	300	21,423.55	26,859.00	-
000982	中银绒业	2014年8月25日	重大事项	4.64	2016年2月25日	5.10	7,260	34,358.02	33,686.40	-
002371	七星电子	2015年10月8日	重大事项	19.28	2016年1月11日	21.21	3,500	104,103.13	67,480.00	-
000028	国药一致	2015年10月21日	重大事项	66.15	-	-	2,600	189,245.18	171,990.00	-
000426	兴业矿业	2015年10月28日	重大事项	7.06	2016年3月21日	7.77	12,238	84,242.10	86,400.28	-
000829	天音控股	2015年11月9日	重大事项	12.22	-	-	13,672	185,935.87	167,071.84	-
002048	宁波华翔	2015年11月19日	重大事项	17.40	-	-	8,800	165,572.68	153,120.00	-
002143	印纪传媒	2015年12月9日	重大事项	40.55	2016年1月5日	36.50	4,600	166,622.95	186,530.00	-
002049	同方国芯	2015年12月11日	重大事项	60.15	2016年3月11日	54.14	5,400	242,467.87	324,810.00	-
300088	长信科技	2015年12月14日	重大事项	14.03	2016年2月29日	12.63	14,400	162,327.30	202,032.00	-
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项	15.80	-	-	12,200	192,480.58	192,760.00	-
000973	佛塑科技	2015年12月18日	重大事项	13.00	2016年2月22日	11.70	15,100	137,337.97	196,300.00	-
002568	百润股份	2015年12月21日	重大事项	42.69	2016年1月18日	38.42	5,300	225,529.00	226,257.00	-
002678	珠江钢琴	2015年12月21日	重大事项	17.21	2016年1月19日	15.49	3,700	63,234.42	63,677.00	-
002242	九阳股份	2015年12月24日	重大事项	22.68	2016年1月11日	20.41	6,000	159,638.07	136,080.00	-
002011	盾安环境	2015年12月28日	重大事项	16.72	2016年2月22日	15.05	9,900	143,212.04	165,528.00	-
002698	博实股份	2015年12月28日	重大事项	29.33	2016年1月5日	26.40	3,990	107,063.02	117,026.70	-

002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事 项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	19,903	305,904.75	302,525.60	-
--------	-----	---------------------	----------	-------	-------------------	-------	--------	------------	------------	---

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	42,148,281.92	97.04
	其中：股票	42,148,281.92	97.04
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	1,279,575.59	2.95
7	其他各项资产	4,192.69	0.01
8	合计	43,432,050.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	1,354,132.05	3.16
B	采矿业	1,247,225.32	2.91
C	制造业	25,880,523.73	60.39

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,248,068.20	2.91
E	建筑业	1,369,646.67	3.20
F	批发和零售业	1,565,747.31	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	407,747.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,505,374.54	8.18
J	金融业	181,636.56	0.42
K	房地产业	2,909,653.94	6.79
L	租赁和商务服务业	1,179,471.80	2.75
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	440,291.80	1.03
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	222,528.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	501,615.00	1.17
S	综合	134,620.00	0.31
	合计	42,148,281.92	98.35

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002466	天齐锂业	3,100	436,325.00	1.02
2	002405	四维图新	11,100	430,680.00	1.00
3	002030	达安基因	9,060	373,090.80	0.87
4	002004	华邦健康	25,800	365,070.00	0.85

5	002439	启明星辰	11,400	364,800.00	0.85
6	002400	省广股份	14,200	357,130.00	0.83
7	002276	万马股份	11,080	333,508.00	0.78
8	000566	海南海药	8,500	330,310.00	0.77
9	002049	同方国芯	5,400	324,810.00	0.76
10	000997	新大陆	12,826	324,754.32	0.76

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	002183	怡亚通	510,959.00	9.79
2	002439	启明星辰	383,891.00	7.35
3	002030	达安基因	348,848.00	6.68
4	002276	万马股份	314,281.00	6.02
5	002085	万丰奥威	302,254.00	5.79
6	002400	省广股份	299,504.00	5.74
7	000656	金科股份	287,661.00	5.51
8	002191	劲嘉股份	287,474.00	5.51
9	300085	银之杰	275,232.00	5.27
10	000566	海南海药	273,999.80	5.25
11	002657	中科金财	262,303.00	5.02
12	000887	中鼎股份	252,658.00	4.84
13	002489	浙江永强	245,413.00	4.70
14	000050	深天马 A	236,814.00	4.54
15	000970	中科三环	235,313.00	4.51
16	300182	捷成股份	233,408.00	4.47
17	300257	开山股份	233,368.00	4.47
18	300122	智飞生物	230,292.96	4.41
19	002368	太极股份	225,753.00	4.32

20	002568	百润股份	225,529.00	4.32
21	002161	远望谷	224,129.00	4.29
22	300055	万邦达	222,446.00	4.26
23	002498	汉缆股份	204,267.30	3.91
24	002217	合力泰	200,272.00	3.84
25	000592	平潭发展	199,526.00	3.82
26	000861	海印股份	196,787.00	3.77
27	002344	海宁皮城	188,159.00	3.60
28	002714	牧原股份	180,197.00	3.45
29	000979	中弘股份	178,762.00	3.42
30	002325	洪涛股份	177,022.00	3.39
31	000697	炼石有色	176,506.00	3.38
32	002308	威创股份	170,196.00	3.26
33	002001	新和成	166,897.00	3.20
34	000650	仁和药业	157,498.00	3.02
35	002603	以岭药业	156,946.00	3.01
36	300026	红日药业	150,574.00	2.88
37	002354	天神娱乐	149,814.00	2.87
38	000519	江南红箭	145,255.00	2.78
39	300033	同花顺	143,660.00	2.75
40	002180	艾派克	142,332.00	2.73
41	002051	中工国际	140,268.00	2.69
42	001696	宗申动力	138,130.00	2.65
43	000786	北新建材	134,297.00	2.57
44	002653	海思科	134,131.00	2.57
45	300134	大富科技	131,380.63	2.52
46	002384	东山精密	131,281.00	2.51
47	002477	雏鹰农牧	129,574.00	2.48
48	002727	一心堂	126,550.00	2.42
49	000930	中粮生化	123,106.00	2.36
50	002414	高德红外	120,839.00	2.31
51	002505	大康牧业	120,424.00	2.31
52	002503	搜于特	117,374.00	2.25
53	002345	潮宏基	116,530.00	2.23
54	002233	塔牌集团	114,159.00	2.19
55	300072	三聚环保	110,220.00	2.11

56	002106	莱宝高科	108,534.00	2.08
57	002271	东方雨虹	108,191.00	2.07
58	000693	华泽钴镍	107,248.00	2.05
59	002203	海亮股份	106,998.00	2.05
60	002466	天齐锂业	106,127.00	2.03

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

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	002183	怡亚通	541,649.00	10.38
2	000540	中天城投	455,195.00	8.72
3	300033	同花顺	404,614.00	7.75
4	300144	宋城演艺	403,161.36	7.72
5	002424	贵州百灵	341,246.00	6.54
6	000415	渤海租赁	291,932.00	5.59
7	002195	二三四五	227,357.00	4.36
8	300059	东方财富	218,610.00	4.19
9	000735	罗牛山	163,942.00	3.14
10	000422	湖北宜化	162,485.00	3.11
11	000788	北大医药	118,154.80	2.26
12	300168	万达信息	116,816.00	2.24
13	000012	南玻 A	114,078.00	2.19
14	002480	新筑股份	108,546.50	2.08
15	002393	力生制药	103,616.00	1.98
16	002249	大洋电机	100,371.00	1.92
17	002574	明牌珠宝	95,454.66	1.83
18	000823	超声电子	95,329.76	1.83
19	000997	新大陆	90,595.00	1.74
20	002275	桂林三金	90,316.20	1.73

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

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	20,102,900.64
卖出股票收入（成交）总额	11,556,781.84

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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前十名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未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	3,875.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	316.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,192.69

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**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002049	同方国芯	324,810.00	0.76	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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
220	88,670.98	17,517,562.00	89.80%	1,990,053.00	10.20%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	87.15%
2	中信期货有限公司—中信期货展弘多策略1号集合资产管理计划	296,962.00	1.52%
3	吴世尧	210,000.00	1.08%
4	中融国际信托有限公司—坤弘1号证券投资集合资金信托计划	200,000.00	1.03%
5	邢秋珍	154,535.00	0.79%
6	黄连财	101,666.00	0.52%
7	王捷飞	84,728.00	0.43%
8	于乐涛	65,425.00	0.34%
9	罗昭义	63,501.00	0.33%
10	肖卫中	57,942.00	0.30%

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(2013年9月12日)基金份额总额	333,508,962.00
本报告期期初基金份额总额	3,606,145.00
本报告期基金总申购份额	26,000,000.00

减:本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-98,530.00
本报告期期末基金份额总额	19,507,615.00

§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

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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人

事变动已按相关规定备案、公告。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期支付的审计费用为 2 万元整。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	
申银万国	1	31,659,682.48	100.00%	28,767.88	100.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

本报告期内本基金新增席位：长城证券。本报告期内本基金退租席位：万和证券。

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

无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日