

大成中证 500 深市交易型开放式指数
证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	大成中证 500 深市 ETF
场内简称	500 深 ETF
基金主代码	159932
交易代码	159932
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 12 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,507,615.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013-10-09

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,995,931.88
本期利润	-6,970,480.08
加权平均基金份额本期利润	-0.3418
本期加权平均净值利润率	-19.63%
本期基金份额净值增长率	-17.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	13,141,953.37
期末可供分配基金份额利润	0.6408
期末基金资产净值	37,351,978.48
期末基金份额净值	1.821
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	54.26%

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

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

字。

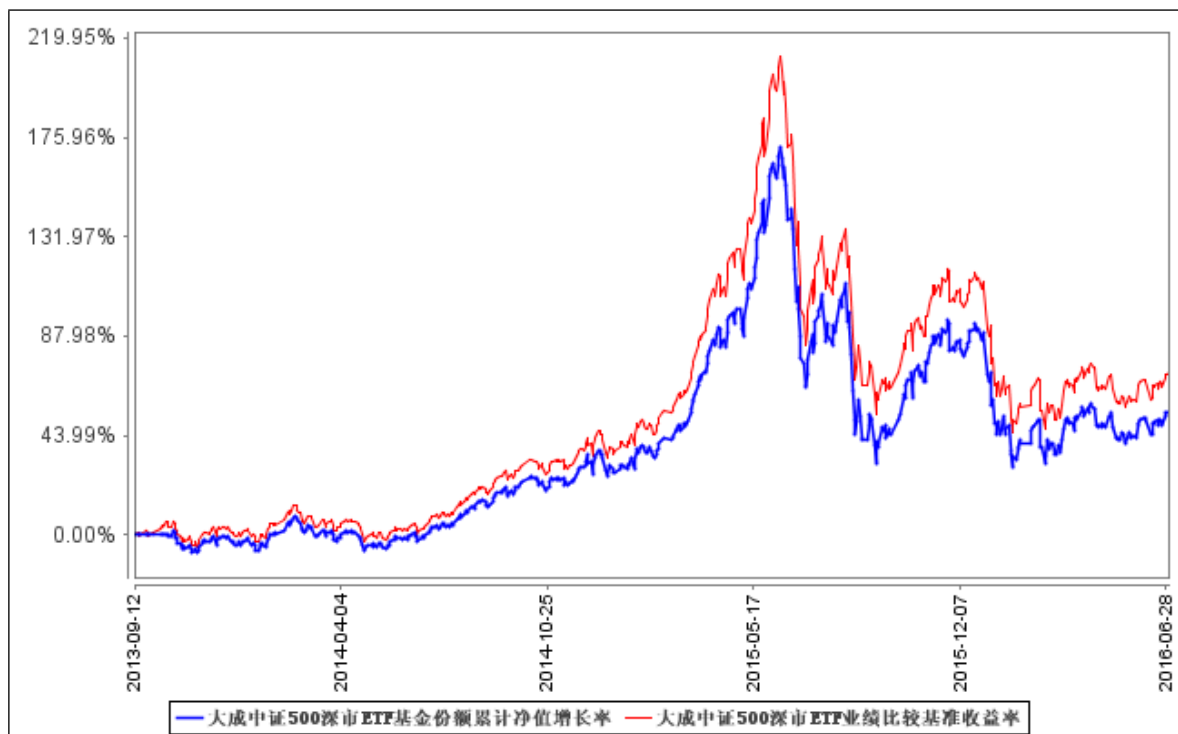
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.76%	1.57%	3.68%	1.61%	0.08%	-0.04%
过去三个月	1.39%	1.68%	1.17%	1.69%	0.22%	-0.01%
过去六个月	-17.11%	2.56%	-17.76%	2.58%	0.65%	-0.02%
过去一年	-26.54%	2.93%	-28.14%	2.85%	1.60%	0.08%
自基金合同生效起至今	54.26%	2.13%	71.42%	2.15%	-17.16%	-0.02%

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。

§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%)。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 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）、大成月添理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置

混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、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、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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
杨台山	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

	理				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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日

内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，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；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，随着政策的摇摆，宏观经济也在不断反复。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一度大幅反弹。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。人民币汇率在保持稳定一段时间后汇率继续贬值，但对出口的提振仍然有限。

国内环境起伏不定，国际环境同样充满变数。欧洲恶性事件层出不穷，英国公投脱欧，各经济体“负利率”愈演愈烈却收效甚微。若应对失当，爆发全球范围的政治、经济危机并非毫无可能。

和宏观经济的先扬后抑相反，股市在上半年走出了结实的“L”型。甫一进入新年，股市便出现暴跌。由于锚定效应，新推行的熔断机制成为了加大市场波动的助推器，和推出该制度的初衷可谓南辕北辙。尽管成命很快被收回，熔断机制无限期暂停，但市场未能迅速恢复元气，继续下挫，直至两会前后开始企稳并开启“慢牛”式反弹。从各基准指数来看，主要的波动发生在一季度，二季度波动幅度相对较小，其中沪深 300 指数下跌 15.47%。大、中、小盘指数表现较为接近，市值因子对市场的影响较小。总体来说，白酒、家电等估值较低的非周期股票表现较好，呈现出良好的防御性。

本基金标的指数中证 500 深市指数下跌 17.76%，跌幅略高于大盘。上半年，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。上半年年化跟踪误差 0.88%，日均偏离度 0.04%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.821 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.11%，同期业绩比较基准收益率为-17.76%，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

展望下半年，宏观经济继续筑底已经成为共识，分歧在于政府对经济下滑容忍的底线，以及是否会据此加码刺激经济。在某种程度上，我国已陷入流动性陷阱，尽管总体流动性非常宽松，但由于税负过重、投资环境恶化等原因，资金脱实向虚，推高金融产品价格，但对实体经济支持力度有限。虽然通胀仍然不高，但货币政策继续放松的边际效应不大，若政府有意刺激经济，将会更多在财政政策上发力。

宏观经济持续低迷，投射到资本市场上，直接体现为上市公司总体盈利下滑，成长放缓。而且，从上市公司大股东减持的热情来看，目前市场估值水平仍然偏高。再加上增量资金难觅，权益市场流动性不足以推动整体牛市，下半年出现鸡犬升天式系统性行情的可能性极小。

从另一方面看，上半年的急跌已经释放了不少风险，而政策面侧重维稳，会尽量避免大波动。综合来看，下半年市场大跌的可能性也不高，预计将反复震荡筑底。局部性机会将主要来自于价值回归。在全社会优质资产稀缺的大背景下，部分基本面良好、估值合理的股票有可能获得增量资金的配置，尤其是分红率较高、具有一定安全边际、可以长期持有的股票。而且，这也符合监管政策的引导方向。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金已按法律法规相关规定向中国证监会报告清盘解决方案，本基金管理人后续将根据法规规定对该事项的最新进展进行信息披露。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	821,029.60	1,271,654.11
结算备付金		1,278.75	7,921.48
存出保证金		2,011.94	3,875.92
交易性金融资产	6.4.3.2	36,963,686.54	42,148,281.92
其中：股票投资		36,952,286.54	42,148,281.92
基金投资		-	-
债券投资		11,400.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	101.47	316.77
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		37,788,108.30	43,432,050.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		175,790.69	368,720.72
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		14,902.95	18,198.75
应付托管费		2,980.60	3,639.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	11,178.02	15,980.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	231,277.56	170,000.00
负债合计		436,129.82	576,539.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	24,210,025.11	23,029,486.80
未分配利润	6.4.3.10	13,141,953.37	19,826,023.69
所有者权益合计		37,351,978.48	42,855,510.49
负债和所有者权益总计		37,788,108.30	43,432,050.20

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.821 元，基金份额总额 20,507,615.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-6,660,674.13	2,823,287.63
1.利息收入		3,634.95	1,441.62
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,632.08	1,441.62
债券利息收入		2.87	-
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）		-1,684,805.91	2,365,070.64
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-1,869,266.69	2,345,565.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	184,460.78	19,504.81
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.3.17	-4,974,548.20	455,141.50

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.18	-4,954.97	1,633.87
减:二、费用		309,805.95	309,104.85
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	88,511.44	13,551.45
2. 托管费	6.4.6.2.2	17,702.28	2,710.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	22,189.67	4,332.63
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	181,402.56	288,510.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,970,480.08	2,514,182.78
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-6,970,480.08	2,514,182.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	23,029,486.80	19,826,023.69	42,855,510.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,970,480.08	-6,970,480.08
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)	1,180,538.31	286,409.76	1,466,948.07
其中: 1. 基金申购款	2,361,076.62	847,580.85	3,208,657.47
2. 基金赎回款	-1,180,538.31	-561,171.09	-1,741,709.40
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)	24,210,025.11	13,141,953.37	37,351,978.48
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	4,096,241.51	1,123,975.83	5,220,217.34
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	2,514,182.78	2,514,182.78
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填 列)	-1,135,905.94	-382,357.78	-1,518,263.72
其中：1.基金申购款	3,506,247.79	3,964,840.91	7,471,088.70
2.基金赎回款	-4,642,153.73	-4,347,198.69	-8,989,352.42
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,960,335.57	3,255,800.83	6,216,136.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

周立新

范瑛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 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

6.4.2.2 营业税、增值税、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（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明**6.4.3.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	821,029.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	821,029.60

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,403,177.12	36,952,286.54	-5,450,890.58
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,400.00	11,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	11,400.00	11,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	42,414,577.12	36,963,686.54	-5,450,890.58

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	97.24

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.55
应收债券利息	2.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.81
合计	101.47

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,178.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,178.02

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	181,277.56
合计	231,277.56

6.4.3.9 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,507,615.00	23,029,486.80
本期申购	2,000,000.00	2,361,076.62
本期赎回(以“-”号填列)	-1,000,000.00	-1,180,538.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	20,507,615.00	24,210,025.11

6.4.3.10 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	33,747,383.26	-13,921,359.57	19,826,023.69
本期利润	-1,995,931.88	-4,974,548.20	-6,970,480.08
本期基金份额交易产生的变动数	1,722,049.92	-1,435,640.16	286,409.76
其中：基金申购款	3,442,397.55	-2,594,816.70	847,580.85
基金赎回款	-1,720,347.63	1,159,176.54	-561,171.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,473,501.30	-20,331,547.93	13,141,953.37

6.4.3.11 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6月30日
活期存款利息收入	3,342.22
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	262.37
其他	27.49
合计	3,632.08

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,451,554.67
股票投资收益——赎回差价收入	-417,712.02
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,869,266.69

6.4.3.12.2 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,227,494.28
减：卖出股票成本总额	8,679,048.95
买卖股票差价收入	-1,451,554.67

6.4.3.12.3 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 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,741,709.40
减：现金支付赎回款总额	31,268.40
减：赎回股票成本总额	2,128,153.02
赎回差价收入	-417,712.02

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末投资资产支持证券。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期末投资衍生工具。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	184,460.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	184,460.78

6.4.3.17 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,974,548.20
——股票投资	-4,974,548.20
——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	-4,974,548.20

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-4,954.97
合计	-4,954.97

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	22,189.67
银行间市场交易费用	-
合计	22,189.67

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	41,497.82
上市年费	29,835.26
银行划款手续费	125.00

指数使用费	100,000.00
合计	181,402.56

注：指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000.00 元。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“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。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金申赎代办券商
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,511.44	13,551.45
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,702.28	2,710.29

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 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
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	82.90%	-

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。

6.4.6.4.2 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之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	821,029.60	3,342.22	662,861.91	1,421.53

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 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。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末(2016 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.8.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016 年 6 月 8 日	2016 年 7 月	新债流通受限	100.00	100.00	114	11,400.00	11,400.00	-

			1 日							
--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.8.2 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
000718	苏宁 环球	2016 年 1 月 4 日	重大 事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	22,500	236,470.64	294,525.00	-
000547	航天 发展	2016 年 4 月 19 日	重大 事项	15.36	-	-	14,600	370,357.76	224,256.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大 事项	8.92	-	-	23,701	228,371.80	211,412.92	-
000975	银泰 资源	2016 年 4 月 19 日	重大 事项	15.00	-	-	11,102	162,772.14	166,530.00	-
002266	浙富 控股	2016 年 5 月 25 日	重大 事项	5.35	-	-	28,420	245,598.73	152,047.00	-
002672	东江 环保	2016 年 5 月 23 日	重大 事项	17.33	2016 年 7 月 15 日	19.06	8,300	155,195.90	143,839.00	-
002512	达华 智能	2016 年 6 月 21 日	重大 事项	20.28	2016 年 7 月 21 日	19.38	7,000	136,522.00	141,960.00	-
002373	千方 科技	2016 年 5 月 12 日	重大 事项	14.94	2016 年 8 月 16 日	16.43	9,200	183,735.53	137,448.00	-
002190	成飞 集成	2016 年 4 月 21 日	重大 事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	3,600	170,481.93	127,584.00	-
000401	冀东	2016	重大	10.90	2016 年 7	11.32	11,100	145,344.17	120,990.00	-

	水泥	年 4 月 6 日	事项		月 14 日						
300032	金龙机电	2016 年 6 月 28 日	重大事项	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	5,400	96,875.00	108,540.00	-	
002663	普邦园林	2016 年 4 月 27 日	重大事项	7.36	-	-	14,000	124,868.19	103,040.00	-	
000636	风华高科	2016 年 3 月 15 日	重大事项	8.84	2016 年 7 月 13 日	9.72	11,000	110,639.09	97,240.00	-	
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	5,500	99,244.54	68,750.00	-	
002249	大洋电机	2016 年 6 月 8 日	重大事项	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	4,448	54,151.39	53,242.56	-	
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大事项	27.47	-	-	1,800	47,664.00	49,446.00	-	
000517	荣安地产	2016 年 6 月 14 日	重大事项	4.84	2016 年 7 月 14 日	4.98	10,100	51,912.00	48,884.00	-	
000582	北部湾港	2016 年 2 月 29 日	重大事项	16.32	-	-	1,800	38,530.74	29,376.00	-	

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。本基金以拟合、跟踪中证 500 深市指数为原则，通过被动式指数化投资方法，力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

6.4.9.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，且通过分散化投资以分散信用风险。本基

金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的证券在证券交易所上市。于本期末，除附注 6.4.8 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的

重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	821,029.60	-	-	-	821,029.60
结算备付金	1,278.75	-	-	-	1,278.75
存出保证金	2,011.94	-	-	-	2,011.94
交易性金融资产	-	-	11,400.00	36,952,286.54	36,963,686.54
应收利息	-	-	-	101.47	101.47
资产总计	824,320.29	-	11,400.00	36,952,388.01	37,788,108.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	175,790.69	175,790.69
应付管理人报酬	-	-	-	14,902.95	14,902.95
应付托管费	-	-	-	2,980.60	2,980.60
应付交易费用	-	-	-	11,178.02	11,178.02
其他负债	-	-	-	231,277.56	231,277.56
负债总计	-	-	-	436,129.82	436,129.82
利率敏感度缺口	824,320.29	-	11,400.00	36,516,258.19	37,351,978.48
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,271,654.11	-	-	-	1,271,654.11
结算备付金	7,921.48	-	-	-	7,921.48
存出保证金	3,875.92	-	-	-	3,875.92
交易性金融资产	-	-	-	42,148,281.92	42,148,281.92
应收利息	-	-	-	316.77	316.77
资产总计	1,283,451.51	-	-	42,148,598.69	43,432,050.20
负债					
应付证券清算款	-	-	-	368,720.72	368,720.72
应付管理人报酬	-	-	-	18,198.75	18,198.75
应付托管费	-	-	-	3,639.75	3,639.75
应付交易费用	-	-	-	15,980.49	15,980.49
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	576,539.71	576,539.71
利率敏感度缺口	1,283,451.51	-	-	41,572,058.98	42,855,510.49

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数型证券投资基金，于本报告期末持有交易性债券投资占资产净值比例为 0.03%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 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	36,952,286.54	98.93	42,148,281.92	98.35
交易性金融资产—基金投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	0.00	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	0.00	—	0.00
其他	—	0.00	—	0.00
合计	36,952,286.54	98.93	42,148,281.92	98.35

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

金额单位：人民币元

假 设	1. 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2. 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	3. Beta 系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分 析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	中证 500 深市指数上升 5%	1,850,574.65	2,169,112.35
	中证 500 深市指数下降 5%	-1,850,574.65	-2,169,112.35

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,952,286.54	97.79
	其中：股票	36,952,286.54	97.79
2	固定收益投资	11,400.00	0.03
	其中：债券	11,400.00	0.03
	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	822,308.35	2.18
7	其他各项资产	2,113.41	0.01
8	合计	37,788,108.30	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,151,059.86	3.08
B	采矿业	1,509,076.76	4.04
C	制造业	22,421,464.82	60.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,111,021.75	2.97
E	建筑业	1,383,802.19	3.70
F	批发和零售业	1,422,692.94	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	313,106.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,656,639.97	9.79
J	金融业	125,863.74	0.34
K	房地产业	2,061,391.81	5.52
L	租赁和商务服务业	630,398.10	1.69
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	343,833.40	0.92
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	202,497.20	0.54
R	文化、体育和娱乐业	539,638.00	1.44
S	综合	79,800.00	0.21
	合计	36,952,286.54	98.93

7.2.2 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。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	11,040	471,297.60	1.26
2	002405	四维图新	15,850	389,910.00	1.04
3	002340	格林美	37,706	330,681.62	0.89
4	300072	三聚环保	11,007	304,233.48	0.81
5	000718	苏宁环球	22,500	294,525.00	0.79
6	002085	万丰奥威	16,900	290,511.00	0.78
7	000661	长春高新	2,560	273,100.80	0.73
8	002049	紫光国芯	6,200	272,490.00	0.73
9	002030	达安基因	9,426	262,042.80	0.70
10	300113	顺网科技	6,900	261,924.00	0.70
11	300253	卫宁健康	10,520	259,844.00	0.70
12	002572	索菲亚	4,500	252,090.00	0.67
13	002439	启明星辰	9,700	250,551.00	0.67
14	002508	老板电器	6,800	250,036.00	0.67
15	000887	中鼎股份	11,300	249,843.00	0.67
16	002400	省广股份	17,470	246,851.10	0.66
17	000997	新大陆	12,226	245,009.04	0.66
18	002179	中航光电	5,593	242,288.76	0.65
19	002426	胜利精密	24,550	241,817.50	0.65
20	002273	水晶光电	8,550	239,314.50	0.64
21	000748	长城信息	12,100	237,402.00	0.64
22	000988	华工科技	11,600	232,580.00	0.62
23	002701	奥瑞金	26,192	231,275.36	0.62
24	000970	中科三环	15,800	229,258.00	0.61
25	002004	华邦健康	25,100	229,163.00	0.61
26	000547	航天发展	14,600	224,256.00	0.60
27	300088	长信科技	15,000	223,050.00	0.60
28	000998	隆平高科	11,638	220,889.24	0.59
29	000050	深天马A	10,400	217,048.00	0.58
30	002131	利欧股份	12,672	216,564.48	0.58
31	000983	西山煤电	26,500	215,975.00	0.58
32	002299	圣农发展	8,300	214,970.00	0.58
33	002001	新和成	10,100	213,413.00	0.57
34	000511	*ST 烯碳	23,701	211,412.92	0.57
35	002038	双鹭药业	7,000	211,260.00	0.57
36	000078	海王生物	28,100	208,783.00	0.56
37	002276	万马股份	10,480	207,608.80	0.56

38	002168	深圳惠程	14,500	204,160.00	0.55
39	300055	万邦达	11,200	203,952.00	0.55
40	002310	东方园林	8,500	203,320.00	0.54
41	300244	迪安诊断	6,140	202,497.20	0.54
42	002573	清新环境	11,820	199,994.40	0.54
43	002191	劲嘉股份	17,100	198,189.00	0.53
44	000930	中粮生化	17,900	196,542.00	0.53
45	000656	金科股份	51,000	194,820.00	0.52
46	000012	南玻 A	17,000	194,820.00	0.52
47	000762	西藏矿业	7,700	190,344.00	0.51
48	002595	豪迈科技	8,900	190,193.00	0.51
49	000697	炼石有色	8,300	189,655.00	0.51
50	002048	宁波华翔	7,900	180,673.00	0.48
51	300274	阳光电源	7,400	180,560.00	0.48
52	002311	海大集团	11,400	179,778.00	0.48
53	002223	鱼跃医疗	5,659	179,503.48	0.48
54	002308	威创股份	10,900	179,087.00	0.48
55	000860	顺鑫农业	7,480	177,874.40	0.48
56	002074	国轩高科	4,500	177,615.00	0.48
57	002714	牧原股份	3,500	176,855.00	0.47
58	000566	海南海药	16,200	176,742.00	0.47
59	000031	中粮地产	18,700	176,341.00	0.47
60	002657	中科金财	3,200	175,808.00	0.47
61	002221	东华能源	14,300	174,317.00	0.47
62	002477	雏鹰农牧	29,000	173,130.00	0.46
63	300115	长盈精密	8,320	171,392.00	0.46
64	000581	威孚高科	8,500	171,360.00	0.46
65	000758	中色股份	21,900	169,725.00	0.45
66	300199	翰宇药业	8,300	168,905.00	0.45
67	300273	和佳股份	8,740	167,371.00	0.45
68	002092	中泰化学	19,700	166,662.00	0.45
69	000975	银泰资源	11,102	166,530.00	0.45
70	002155	湖南黄金	12,600	165,942.00	0.44
71	000979	中弘股份	60,420	165,550.80	0.44
72	300043	互动娱乐	11,600	164,372.00	0.44
73	000690	宝新能源	24,200	164,076.00	0.44
74	002444	巨星科技	8,000	162,560.00	0.44
75	300182	捷成股份	9,500	162,545.00	0.44
76	002217	合力泰	10,600	162,180.00	0.43

77	002022	科华生物	7,600	161,956.00	0.43
78	000671	阳光城	27,250	161,865.00	0.43
79	002410	广联达	11,300	161,590.00	0.43
80	300010	立思辰	7,700	161,546.00	0.43
81	002665	首航节能	20,350	160,561.50	0.43
82	002271	东方雨虹	9,300	160,239.00	0.43
83	002366	台海核电	3,000	159,930.00	0.43
84	002013	中航机电	11,860	159,872.80	0.43
85	000598	兴蓉环境	30,200	159,456.00	0.43
86	002489	浙江永强	20,130	159,429.60	0.43
87	300291	华录百纳	6,700	157,651.00	0.42
88	000400	许继电气	10,200	157,488.00	0.42
89	002268	卫士通	4,400	157,256.00	0.42
90	000066	长城电脑	12,300	156,825.00	0.42
91	002353	杰瑞股份	8,100	156,168.00	0.42
92	002250	联化科技	10,844	155,286.08	0.42
93	002051	中工国际	7,880	154,999.60	0.41
94	000008	神州高铁	14,000	152,460.00	0.41
95	002266	浙富控股	28,420	152,047.00	0.41
96	000727	华东科技	45,700	150,810.00	0.40
97	000021	深科技	13,600	149,736.00	0.40
98	000028	国药一致	2,300	149,730.00	0.40
99	000973	佛塑科技	14,300	149,292.00	0.40
100	300026	红日药业	8,500	147,815.00	0.40
101	300001	特锐德	6,800	147,492.00	0.39
102	002431	棕榈股份	12,800	147,200.00	0.39
103	002073	软控股份	12,200	147,010.00	0.39
104	300134	大富科技	4,880	146,204.80	0.39
105	002428	云南锗业	8,502	146,064.36	0.39
106	000878	云南铜业	14,300	145,574.00	0.39
107	000592	平潭发展	21,400	145,092.00	0.39
108	300287	飞利信	10,800	144,720.00	0.39
109	002672	东江环保	8,300	143,839.00	0.39
110	002325	洪涛股份	15,611	143,465.09	0.38
111	002161	远望谷	9,600	142,944.00	0.38
112	000829	天音控股	10,672	142,471.20	0.38
113	002512	达华智能	7,000	141,960.00	0.38
114	000543	皖能电力	19,870	141,871.80	0.38
115	002437	誉衡药业	16,300	141,810.00	0.38

116	000616	海航投资	26,500	141,510.00	0.38
117	001696	宗申动力	12,800	139,776.00	0.37
118	002371	七星电子	3,300	138,006.00	0.37
119	002373	千方科技	9,200	137,448.00	0.37
120	002368	太极股份	3,860	137,145.80	0.37
121	002063	远光软件	8,773	135,542.85	0.36
122	000667	美好集团	37,900	135,303.00	0.36
123	000777	中核科技	5,700	134,292.00	0.36
124	000418	小天鹅 A	4,100	133,742.00	0.36
125	002603	以岭药业	8,400	133,644.00	0.36
126	000969	安泰科技	9,500	133,285.00	0.36
127	002624	完美环球	3,500	132,125.00	0.35
128	000488	晨鸣纸业	16,500	131,010.00	0.35
129	002354	天神娱乐	1,500	130,920.00	0.35
130	000848	承德露露	10,954	130,900.30	0.35
131	000786	北新建材	14,300	129,844.00	0.35
132	002056	横店东磁	7,620	129,540.00	0.35
133	000685	中山公用	12,460	129,334.80	0.35
134	002050	三花股份	13,400	129,310.00	0.35
135	000006	深振业 A	17,500	128,975.00	0.35
136	002440	闰土股份	8,600	127,710.00	0.34
137	002375	亚厦股份	11,300	127,690.00	0.34
138	002190	成飞集成	3,600	127,584.00	0.34
139	300147	香雪制药	8,640	127,267.20	0.34
140	002699	美盛文化	3,800	126,882.00	0.34
141	000563	陕国投 A	22,926	125,863.74	0.34
142	000939	凯迪生态	14,017	125,452.15	0.34
143	002384	东山精密	6,300	125,118.00	0.33
144	000926	福星股份	10,596	124,291.08	0.33
145	000816	智慧农业	21,000	124,110.00	0.33
146	002002	鸿达兴业	6,600	124,080.00	0.33
147	002642	荣之联	4,700	123,657.00	0.33
148	300202	聚龙股份	5,100	123,471.00	0.33
149	000681	视觉中国	5,200	122,980.00	0.33
150	000810	创维数字	6,800	122,876.00	0.33
151	000519	江南红箭	9,633	122,435.43	0.33
152	000587	金洲慈航	7,900	121,897.00	0.33
153	002414	高德红外	4,500	121,365.00	0.32
154	000401	冀东水泥	11,100	120,990.00	0.32

155	002505	大康农业	30,530	119,067.00	0.32
156	002025	航天电器	4,810	118,758.90	0.32
157	002396	星网锐捷	6,000	118,200.00	0.32
158	002285	世联行	15,160	118,096.40	0.32
159	002390	信邦制药	12,700	117,348.00	0.31
160	002681	奋达科技	6,920	116,809.60	0.31
161	002589	瑞康医药	3,800	116,698.00	0.31
162	002640	跨境通	6,600	116,292.00	0.31
163	000600	建投能源	13,300	116,109.00	0.31
164	002244	滨江集团	17,300	115,910.00	0.31
165	002281	光迅科技	1,800	115,560.00	0.31
166	000961	中南建设	20,550	115,285.50	0.31
167	002011	盾安环境	10,200	115,056.00	0.31
168	000541	佛山照明	10,960	112,778.40	0.30
169	000612	焦作万方	15,740	112,383.60	0.30
170	000513	丽珠集团	2,414	111,309.54	0.30
171	002635	安洁科技	2,900	111,302.00	0.30
172	000572	海马汽车	21,300	110,547.00	0.30
173	002106	莱宝高科	9,200	109,296.00	0.29
174	002254	泰和新材	7,940	108,936.80	0.29
175	300032	金龙机电	5,400	108,540.00	0.29
176	000062	深圳华强	4,000	108,000.00	0.29
177	002588	史丹利	8,700	107,445.00	0.29
178	002005	德豪润达	18,100	106,971.00	0.29
179	002028	思源电气	9,765	106,926.75	0.29
180	002498	汉缆股份	24,600	106,764.00	0.29
181	300257	开山股份	6,400	105,728.00	0.28
182	000596	古井贡酒	2,200	105,490.00	0.28
183	000869	张裕 A	2,600	104,468.00	0.28
184	002078	太阳纸业	21,400	104,432.00	0.28
185	002261	拓维信息	7,500	103,725.00	0.28
186	002242	九阳股份	5,700	103,626.00	0.28
187	002358	森源电气	6,700	103,381.00	0.28
188	000861	海印股份	20,860	103,048.40	0.28
189	002663	普邦园林	14,000	103,040.00	0.28
190	002269	美邦服饰	23,400	102,960.00	0.28
191	000099	中信海直	7,900	102,700.00	0.27
192	002344	海宁皮城	10,400	101,400.00	0.27
193	002315	焦点科技	1,500	101,190.00	0.27

194	002041	登海种业	6,503	101,056.62	0.27
195	002093	国脉科技	8,100	100,521.00	0.27
196	002479	富春环保	8,900	99,947.00	0.27
197	002317	众生药业	8,200	98,318.00	0.26
198	002463	沪电股份	18,578	98,091.84	0.26
199	000090	天健集团	11,100	97,680.00	0.26
200	002727	一心堂	3,900	97,500.00	0.26
201	000636	风华高科	11,000	97,240.00	0.26
202	000620	新华联	10,600	96,990.00	0.26
203	000049	德赛电池	2,300	96,462.00	0.26
204	000669	金鸿能源	5,750	96,025.00	0.26
205	002309	中利科技	5,340	95,639.40	0.26
206	000937	冀中能源	17,900	95,228.00	0.25
207	000528	柳工	14,600	94,608.00	0.25
208	002551	尚荣医疗	4,040	94,455.20	0.25
209	300039	上海凯宝	9,240	93,970.80	0.25
210	000550	江铃汽车	3,841	93,566.76	0.25
211	000726	鲁泰A	8,400	93,324.00	0.25
212	002503	搜于特	7,494	93,075.48	0.25
213	000088	盐田港	14,400	92,736.00	0.25
214	000897	津滨发展	23,900	92,493.00	0.25
215	000680	山推股份	18,400	90,712.00	0.24
216	002064	华峰氨纶	18,600	89,280.00	0.24
217	000158	常山股份	6,400	88,896.00	0.24
218	000900	现代投资	13,100	88,294.00	0.24
219	000652	泰达股份	19,139	88,039.40	0.24
220	002482	广田股份	11,500	87,170.00	0.23
221	000501	鄂武商A	5,506	86,389.14	0.23
222	000830	鲁西化工	19,000	85,880.00	0.23
223	002029	七匹狼	8,400	85,260.00	0.23
224	002277	友阿股份	7,400	85,248.00	0.23
225	000426	兴业矿业	11,038	83,005.76	0.22
226	002128	露天煤业	11,000	82,610.00	0.22
227	000417	合肥百货	10,200	82,518.00	0.22
228	000552	靖远煤电	23,100	81,312.00	0.22
229	000931	中关村	10,000	79,800.00	0.21
230	002118	紫鑫药业	5,400	79,380.00	0.21
231	002267	陕天然气	7,500	78,750.00	0.21
232	002332	仙琚制药	6,850	76,720.00	0.21

233	002345	潮宏基	7,800	76,284.00	0.20
234	002251	步步高	5,760	74,707.20	0.20
235	000919	金陵药业	5,686	74,429.74	0.20
236	002698	博实股份	3,790	72,995.40	0.20
237	002408	齐翔腾达	13,194	72,435.06	0.19
238	000703	恒逸石化	7,300	72,051.00	0.19
239	002342	巨力索具	12,400	71,920.00	0.19
240	000877	天山股份	11,540	71,317.20	0.19
241	002293	罗莱生活	5,200	71,240.00	0.19
242	002181	粤传媒	8,660	71,098.60	0.19
243	002646	青青稞酒	3,400	70,074.00	0.19
244	002122	天马股份	11,063	68,811.86	0.18
245	000693	ST 华泽	5,500	68,750.00	0.18
246	000030	富奥股份	9,400	67,398.00	0.18
247	002327	富安娜	7,764	66,071.64	0.18
248	000631	顺发恒业	13,519	65,837.53	0.18
249	002602	世纪华通	3,500	64,855.00	0.17
250	002194	武汉凡谷	4,700	60,066.00	0.16
251	002392	北京利尔	11,100	54,834.00	0.15
252	002233	塔牌集团	6,700	53,801.00	0.14
253	002249	大洋电机	4,448	53,242.56	0.14
254	002216	三全食品	5,952	51,187.20	0.14
255	002745	木林森	1,500	50,985.00	0.14
256	002238	天威视讯	3,440	49,776.80	0.13
257	300166	东方国信	1,800	49,446.00	0.13
258	000517	荣安地产	10,100	48,884.00	0.13
259	002678	珠江钢琴	3,600	44,172.00	0.12
260	002461	珠江啤酒	3,800	44,156.00	0.12
261	000582	北部湾港	1,800	29,376.00	0.08

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	300113	顺网科技	290,929.00	0.68
2	000748	长城信息	259,424.18	0.61
3	002572	索菲亚	245,379.00	0.57
4	002426	胜利精密	240,279.00	0.56
5	002131	利欧股份	210,407.66	0.49
6	300287	飞利信	209,384.48	0.49
7	002038	双鹭药业	207,711.00	0.48
8	000983	西山煤电	196,946.00	0.46
9	002310	东方园林	195,334.00	0.46
10	002174	游族网络	193,155.00	0.45
11	000066	长城电脑	186,319.00	0.43
12	002353	杰瑞股份	169,567.29	0.40
13	000008	神州高铁	166,939.00	0.39
14	000581	威孚高科	164,917.00	0.38
15	002074	国轩高科	163,777.00	0.38
16	000598	兴蓉环境	161,177.00	0.38
17	000727	华东科技	155,240.00	0.36
18	000400	许继电气	153,924.00	0.36
19	002410	广联达	149,631.00	0.35
20	002268	卫士通	149,474.00	0.35

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002174	游族网络	219,696.00	0.51
2	300267	尔康制药	193,702.00	0.45
3	300122	智飞生物	191,309.56	0.45
4	300085	银之杰	188,549.60	0.44
5	002180	艾派克	170,772.56	0.40
6	000732	泰禾集团	152,033.81	0.35
7	300291	华录百纳	150,606.00	0.35
8	002237	恒邦股份	141,152.00	0.33
9	000650	仁和药业	139,194.04	0.32
10	002568	百润股份	126,560.00	0.30

11	002143	印纪传媒	124,576.54	0.29
12	002653	海思科	109,709.00	0.26
13	000603	盛达矿业	105,253.00	0.25
14	000933	*ST 神火	99,973.00	0.23
15	002444	巨星科技	94,748.00	0.22
16	300287	飞利信	89,355.00	0.21
17	002466	天齐锂业	78,975.00	0.18
18	002203	海亮股份	75,349.46	0.18
19	002140	东华科技	67,054.00	0.16
20	002204	大连重工	66,500.20	0.16

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,763,190.79
卖出股票收入（成交）总额	7,257,643.08

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	11,400.00	0.03
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	11,400.00	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	114	11,400.00	0.03

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,011.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	101.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,113.41

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000718	苏宁环球	294,525.00	0.79	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
256	80,107.87	17,020,600.00	83.00%	3,487,015.00	17.00%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	大成基金管理有限公司	17,000,000.00	82.90%

2	龙润华	459,400.00	2.24%
3	刘秀媛	250,000.00	1.22%
4	何凤珍	199,700.00	0.97%
5	邢秋珍	163,387.00	0.80%
6	史应光	119,588.00	0.58%
7	杨诚	107,700.00	0.53%
8	马艳江	102,589.00	0.50%
9	黄连财	101,666.00	0.50%
10	莫祖京	87,300.00	0.43%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	19,507,615.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	20,507,615.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	14,960,536.27	100.00%	13,635.40	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%	-
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%	-
恒泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	1	-	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%	-
方正证券	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%	-
平安证券	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：恒泰证券（000885）；方正证券（000925）；平安证券（397165）。

本报告期内本基金退租席位：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成中证 500 深市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
2	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
3	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
4	大成中证 500 深市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
5	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2016 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
6	大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2016 年 1 期)-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
7	大成基金管理有限公司关于公司	中国证监会指定报	2016 年 1 月 5 日

	旗下部分基金估值调整的公告	刊及本公司网站	
8	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
9	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
10	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 1 月 8 日
11	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
12	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 14 日
13	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
14	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 18 日
15	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
16	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
17	大成基金管理有限公司关于网上直销端银联通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
18	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
19	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
20	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 18 日
21	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 2 月 26 日
22	大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 27 日

23	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
24	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 12 日
25	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 17 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 18 日
27	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 3 月 24 日
28	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
29	大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
30	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
31	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 4 月 6 日
32	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 4 月 14 日
33	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
34	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
35	大成基金管理来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
36	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 4 月 29 日
37	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 30 日

38	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
39	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
40	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
41	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日
42	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
43	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
44	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
45	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
46	关于暂停通联-中行结算方式定投扣款功能的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日