

大成沪深 300 指数证券投资基金  
2014 年半年度报告  
2014 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 22 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 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 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.....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金
基金简称	大成沪深 300 指数
基金主代码	519300
前端交易代码	519300
后端交易代码	519301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 6 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	5,969,701,475.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@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		张树忠	蒋超良

## 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	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
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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-121,554,754.37
本期利润	-248,927,978.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0433
本期加权平均净值利润率	-6.21%
本期基金份额净值增长率	-5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-1,811,844,753.48
期末可供分配基金份额利润	-0.3035
期末基金资产净值	4,157,856,722.07
期末基金份额净值	0.6965
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	69.42%

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）。

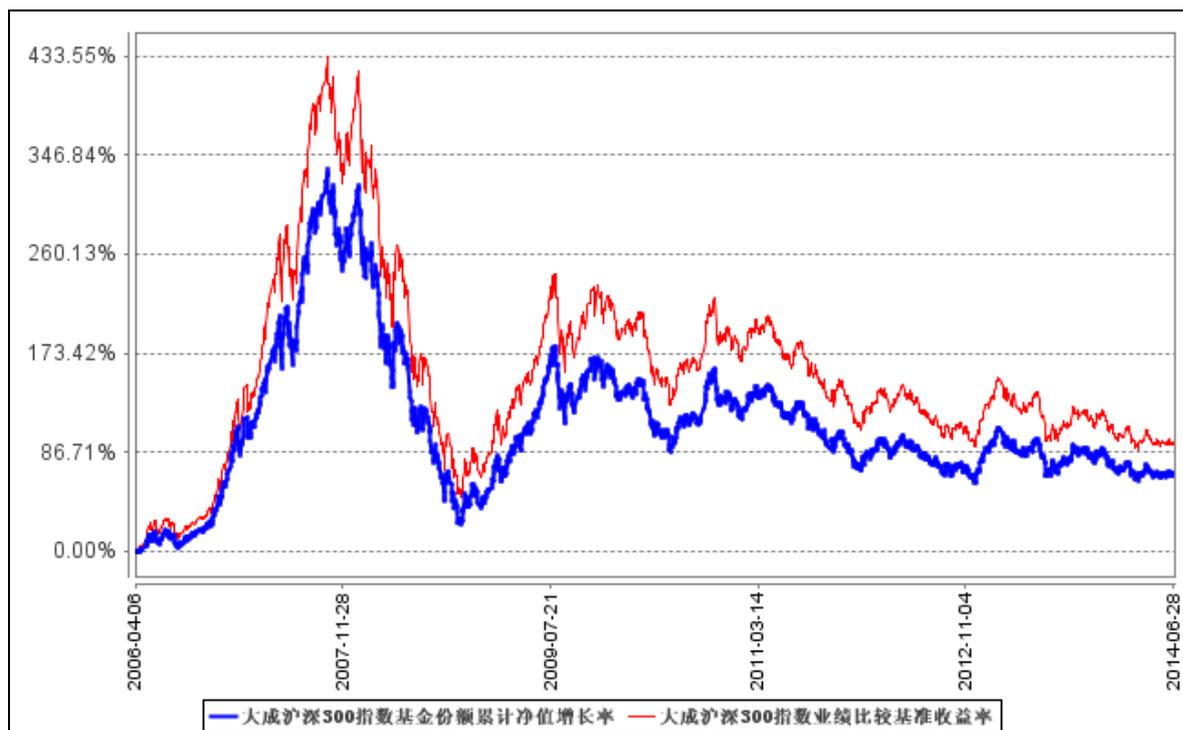
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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
过去一个月	1.06%	0.70%	0.40%	0.78%	0.66%	-0.08%
过去三个月	1.78%	0.80%	0.88%	0.87%	0.90%	-0.07%
过去六个月	-5.70%	0.95%	-7.08%	1.04%	1.38%	-0.09%
过去一年	0.10%	1.08%	-1.61%	1.17%	1.71%	-0.09%
过去三年	-24.52%	1.21%	-28.87%	1.30%	4.35%	-0.09%
自基金合同生效起至今	69.42%	1.78%	96.25%	1.89%	-26.83%	-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，本基金的初始建仓期为 6 个月。截至本报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例。

## § 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：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、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 100 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，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 37 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、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财 21 天债券型发起式基金、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、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

#### 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	2013 年 1 月 1 日	-	10 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。2011 年 3 月 3 日至 2012 年 2 月 8 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。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 日起担任深证成长 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 日开始兼任大成沪深 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。现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理。具有基金从业资格。国籍: 中国
张钟玉 女士	本 基 金 基 金 经 理 助 理	2013 年 3 月 25 日	-	4 年	会计学硕士, 2010 年 4 月加入大成基金管理有限公司从事研究工作, 现任数量投资部数量分析师。2013 年 3 月 25 日起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。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》、《大成沪深 300 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, 大成沪深 300 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。2014 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 3 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，经济形势以及政府的思路都有所转变。起初，在促转型的指导思想下，政府对宏观经济增速下滑表现出较高的容忍度。然而，随着实体经济不断恶化，二季度政府宏观调控的思路产生了一定的变化，“稳增长”的目标权重有所增加，体现为连续的微刺激加码投资、定向宽松、调整存贷比等一系列政策。上述措施也起到了一定的作用，五、六月数据表明，宏观经济下滑已经得到了缓解，尽管断言宏观经济见底回升还为时尚早。

A 股市场的走势也忠实反映了宏观经济基本面走势以及政策放松的效果，先是震荡下行，然后在重要指数点位附近反复震荡筑底。A 股市场基准沪深 300 指数下跌 7.08%。存量资金博弈的特征依旧明显，行业和风格轮换较为频繁。总体来说，以创业板为代表的成长股依然仍跑赢大市。在行业方面，计算机、通信、电子等行业领先大市，受消息面刺激的国防军工也有不错表现，而

煤炭、农林牧渔、非银金融等行业则跌幅较深。

上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金在基金合同允许的范围内，保持了较高仓位，并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。本报告期年化跟踪误差 1.53%，日均偏离度 0.07%，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 0.6965 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.70%，同期业绩比较基准收益率为-7.08%，高于业绩比较基准的表现。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济下季度仍然处于探底、转型的过程当中，总体下行趋势一时难以改变，而政府的应对方式及其政策的效果则存在较高的不确定性。虽然之前密集的“托底”政策确实起到了稳增长的效果，但其代价则是延缓了改革进程，而且依靠投资拉动经济的传统刺激方式边际作用递减，长期来看该政策不可延续。下一阶段，只要社会就业情况不触及政府预期区间下限，即使经济增速下滑，大规模的刺激政策也不会出台。此外，经济转型无法迅速完成，新兴行业短期还未能构成重要支撑，实体经济仍然不能乐观。

至于货币政策，其症结在于央行释放的流动性难以惠及实体经济。由于制度性的原因，资源要素配置被扭曲，央行通过各种手段释放的流动性主要流向效率较低的领域，总体社会融资成本依然高企。上述情况短期内难以改变，下季度资金面仍将维持结构性宽松的局面。

对于 A 股市场，基本面和资金面均不构成牛市的基础，除非有重大制度性变革，就此反转的可能性极低。另一方面，当前大市处于低位，且 IPO 重启已经落地，市场向下空间也相对有限。预计下季度 A 股市场仍然呈震荡态势，但波动率有望走出低谷。股市增量资金难觅，存量博弈的格局难以打破，以创业板为代表的成长股、概念股将成为投资者博弈的主要对象。在波动增大的情况下，半年报业绩对上述高估值股票尤为关键。

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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托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、固定收益部、风险管理部和委托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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 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。

### § 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	227,997,434.78	185,285,676.69
结算备付金		814,952.26	-
存出保证金		176,888.57	694,790.75
交易性金融资产	6.4.3.2	3,823,639,183.90	4,155,855,834.63
其中：股票投资		3,773,554,183.90	3,947,017,834.63
基金投资		-	-
债券投资		50,085,000.00	208,838,000.00
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	363,904.70	2,799,423.65
应收股利		-	-
应收申购款		300,074,372.46	456,178.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		4,353,066,736.67	4,345,091,903.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		188,764,551.40	-
应付赎回款		2,527,613.93	1,906,333.58
应付管理人报酬		2,375,377.56	2,832,357.32
应付托管费		475,075.52	566,471.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	846,715.32	885,209.03
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	220,680.87	243,805.50
负债合计		195,210,014.60	6,434,176.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	5,969,701,475.55	5,874,017,400.92
未分配利润	6.4.3.10	-1,811,844,753.48	-1,535,359,674.02
所有者权益合计		4,157,856,722.07	4,338,657,726.90
负债和所有者权益总计		4,353,066,736.67	4,345,091,903.80

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.6965 元，基金份额总额 5,969,701,475.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-229,324,137.13	-489,839,718.79
1. 利息收入		4,654,703.76	1,478,086.68
其中：存款利息收入	6.4.3.11	626,309.22	1,478,086.68
债券利息收入		4,028,394.54	-
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）		-107,072,339.72	-94,076,764.25
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-151,072,304.15	-151,953,514.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	1,084,420.00	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	42,915,544.43	57,876,749.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-127,373,224.56	-397,768,620.95
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	466,723.39	527,579.73
<b>减：二、费用</b>		19,603,841.80	26,061,358.35
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	14,935,360.91	19,611,716.81
2. 托管费	6.4.6.2.2	2,987,072.19	3,922,343.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	1,452,732.39	2,297,395.83
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	228,676.31	229,902.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-248,927,978.93	-515,901,077.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-248,927,978.93	-515,901,077.14

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,874,017,400.92	-1,535,359,674.02	4,338,657,726.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-248,927,978.93	-248,927,978.93
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）	95,684,074.63	-27,557,100.53	68,126,974.10
其中：1. 基金申购款	989,932,853.62	-300,611,034.28	689,321,819.34
2. 基金赎回款	-894,248,778.99	273,053,933.75	-621,194,845.24
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）	5,969,701,475.55	-1,811,844,753.48	4,157,856,722.07
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	7,242,994,681.20	-1,581,189,759.51	5,661,804,921.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-515,901,077.14	-515,901,077.14
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）	-837,792,825.10	148,473,310.28	-689,319,514.82
其中：1. 基金申购款	554,367,566.95	-113,691,619.36	440,675,947.59
2. 基金赎回款	-1,392,160,392.05	262,164,929.64	-1,129,995,462.41
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）	6,405,201,856.10	-1,948,617,526.37	4,456,584,329.73

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：

<u>张树忠</u>	<u>刘彩晖</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

## 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相一致。

### 6.4.2 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对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 20% 的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	227,997,434.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	227,997,434.78

注：本基金于本期末投资于定期存款或其他存款。

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,506,130,227.08	3,773,554,183.90	-732,576,043.18	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	50,125,550.00	50,085,000.00	-40,550.00
	合计	50,125,550.00	50,085,000.00	-40,550.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,556,255,777.08	3,823,639,183.90	-732,616,593.18	

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本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

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.3.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	36,790.70
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	330.03
应收债券利息	326,712.33
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	71.64
合计	363,904.70

**6.4.3.6 其他资产**

本基金于本期末未持有其他资产。

**6.4.3.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	845,265.32
银行间市场应付交易费用	1,450.00
合计	846,715.32

**6.4.3.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,490.80
预提费用	218,190.07
合计	220,680.87

**6.4.3.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,874,017,400.92	5,874,017,400.92
本期申购	989,932,853.62	989,932,853.62
本期赎回(以“-”号填列)	-894,248,778.99	-894,248,778.99
本期末	5,969,701,475.55	5,969,701,475.55

#### 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	-125,570,603.41	-1,409,789,070.61	-1,535,359,674.02
本期利润	-121,554,754.37	-127,373,224.56	-248,927,978.93
本期基金份额交易产生的变动数	-9,491,637.02	-18,065,463.51	-27,557,100.53
其中：基金申购款	-31,937,210.54	-268,673,823.74	-300,611,034.28
基金赎回款	22,445,573.52	250,608,360.23	273,053,933.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-256,616,994.80	-1,555,227,758.68	-1,811,844,753.48

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	618,337.01
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	4,780.94
其他	3,191.27
合计	626,309.22

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	440,953,571.16
减：卖出股票成本总额	592,025,875.31
买卖股票差价收入	-151,072,304.15

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	265,965,035.85

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	258,112,240.00
减：应收利息总额	6,768,375.85
债券投资收益	1,084,420.00

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属产生的收益/损失。

#### 6.4.3.15 衍生工具投资收益

本基金于本期无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.3.16 股利投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	42,915,544.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	42,915,544.43

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-127,373,224.56
——股票投资	-127,494,304.56
——债券投资	121,080.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-127,373,224.56

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	466,723.39
合计	466,723.39

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日

交易所市场交易费用	1,450,607.39
银行间市场交易费用	2,125.00
合计	1,452,732.39

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	1,486.24
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	228,676.31

#### 6.4.3.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司（“广东证券”）	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合资子公司

注：1) 中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 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

##### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	292,377,264.36	29.76%	643,236,743.49	49.21%

##### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30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	262,164.41	29.58%	262,164.41	31.02%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	578,945.26	49.05%	78,773.99	27.07%

注：1) 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

##### 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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	14,935,360.91	19,611,716.81
其中：支付销售机构的客户维护费	3,711,765.18	4,758,178.94

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,987,072.19	3,922,343.37

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（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

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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
中国农业银行	227,997,434.78	618,337.01	415,217,204.78	1,470,306.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间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

本基金本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

本基金于本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2014 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.8.2 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
600637	百视通	2014-5-29	重大事项	32.03	-	-	636,931	15,888,171.91	20,400,899.93	-
600832	东方明珠	2014-5-29	重大事项	10.98	-	-	1,173,172	11,360,292.60	12,881,428.56	-
000009	中国宝安	2014-5-28	重大事项	10.21	2014-8-15	8.48	951,452	8,506,790.52	9,714,324.92	-
000562	宏源证券	2013-10-31	重大事项	8.22	2014-7-28	8.93	1,004,041	10,859,132.31	8,253,217.02	-
601669	中国电建	2014-5-13	重大事项	2.79	-	-	2,851,388	12,028,732.96	7,955,372.52	-
002570	贝因美	2014-6-19	重大事项	14.36	-	-	428,653	4,612,398.11	6,155,457.08	-
600516	方大炭素	2014-6-30	重大事项	9.59	2014-7-2	9.05	619,469	4,910,087.12	5,940,707.71	-
000960	锡业	2014-5-6	重大事项	12.44	2014-8-5	13.68	347,679	6,988,077.74	4,325,126.76	-

	股份									
600498	烽火通信	2014-6-30	重大事项	11.91	2014-7-7	12.10	346,001	4,640,124.63	4,120,871.91	-
000878	云南铜业	2014-4-17	重大事项	7.61	2014-7-17	7.50	531,114	10,653,570.17	4,041,777.54	-
000536	华映科技	2014-5-23	重大事项	23.10	2014-8-20	25.41	107,077	2,639,349.88	2,473,478.70	-

注：本基金截至 2014 年 06 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

##### 6.4.8.3.1 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。

##### 6.4.8.3.2 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。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 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、拒绝支付到年本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资

于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 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。本基金所持有的证券在证券交易所上市。于本期末，除附注 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

#### 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、债券等。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	227,997,434.78	-	-	-	227,997,434.78
结算备付金	814,952.26	-	-	-	814,952.26
存出保证金	176,888.57	-	-	-	176,888.57
交易性金融资产	50,085,000.00	-	-	-3,773,554,183.90	3,823,639,183.90
应收利息	-	-	-	363,904.70	363,904.70
应收申购款	300,009,426.27	-	-	64,946.19	300,074,372.46
资产总计	579,083,701.88	-	-	-3,773,983,034.79	4,353,066,736.67
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	188,764,551.40	188,764,551.40
应付赎回款	-	-	-	2,527,613.93	2,527,613.93
应付管理人报酬	-	-	-	2,375,377.56	2,375,377.56
应付托管费	-	-	-	475,075.52	475,075.52
应付交易费用	-	-	-	846,715.32	846,715.32
其他负债	-	-	-	220,680.87	220,680.87
负债总计	-	-	-	195,210,014.60	195,210,014.60
利率敏感度缺口	579,083,701.88	-	-	-3,578,773,020.19	4,157,856,722.07
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	185,285,676.69	-	-	-	185,285,676.69
存出保证金	694,790.75	-	-	-	694,790.75
交易性金融资产	208,838,000.00	-	-	-3,947,017,834.63	4,155,855,834.63
应收利息	-	-	-	2,799,423.65	2,799,423.65
应收申购款	62,407.29	-	-	393,770.79	456,178.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	394,880,874.73	-	-	-3,950,211,029.07	4,345,091,903.80
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,906,333.58	1,906,333.58
应付管理人报酬	-	-	-	2,832,357.32	2,832,357.32
应付托管费	-	-	-	566,471.47	566,471.47
应付交易费用	-	-	-	885,209.03	885,209.03
其他负债	-	-	-	243,805.50	243,805.50
负债总计	-	-	-	6,434,176.90	6,434,176.90
利率敏感度缺口	394,880,874.73	-	-	-3,943,776,852.17	4,338,657,726.90

## 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表
----	--

示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014 年 06 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基准点	-103,317.02	-258,298.86
利率下降 25 个基准点	103,744.24	259,075.07	

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，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。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	3,773,554,183.90	90.76	3,947,017,834.63	90.97
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	50,085,000.00	1.20	208,838,000.00	4.81
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	3,823,639,183.90	91.96	4,155,855,834.63	95.79
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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。下表为市场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。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	189,340,000.00	200,998,260.82
沪深 300 指数下降 5%	-189,340,000.00	-200,998,260.82	

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	3,773,554,183.90	86.69
	其中：股票	3,773,554,183.90	86.69
2	固定收益投资	50,085,000.00	1.15
	其中：债券	50,085,000.00	1.15
	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	228,812,387.04	5.26
7	其他各项资产	300,615,165.73	6.91
8	合计	4,353,066,736.67	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,034,876.08	0.29
B	采矿业	212,673,195.08	5.11

C	制造业	1,372,935,412.85	33.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,903,976.55	3.17
E	建筑业	119,676,604.73	2.88
F	批发和零售业	102,529,415.33	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	93,783,396.96	2.26
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,952,158.87	3.49
J	金融业	1,273,170,551.12	30.62
K	房地产业	173,793,703.54	4.18
L	租赁和商务服务业	45,599,327.36	1.10
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	34,585,547.07	0.83
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	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	23,001,613.94	0.55
S	综合	32,914,404.42	0.79
	合计	3,773,554,183.90	90.76

### 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

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	600036	招商银行	16,260,695	166,509,516.80	4.00
2	601318	中国平安	3,628,469	142,743,970.46	3.43
3	600016	民生银行	20,548,893	127,608,625.53	3.07
4	601166	兴业银行	8,663,419	86,894,092.57	2.09
5	601939	建设银行	19,341,486	79,880,337.18	1.92
6	600000	浦发银行	8,484,651	76,786,091.55	1.85
7	600030	中信证券	5,965,972	68,370,039.12	1.64
8	000002	万科A	7,338,827	60,692,099.29	1.46
9	600837	海通证券	6,132,500	56,112,375.00	1.35
10	000651	格力电器	1,823,378	53,698,482.10	1.29
11	600519	贵州茅台	346,134	49,144,105.32	1.18
12	601328	交通银行	11,898,811	46,167,386.68	1.11

13	601398	工商银行	12,984,338	44,016,905.82	1.06
14	000001	平安银行	4,329,103	42,901,410.73	1.03
15	601601	中国太保	2,381,699	42,370,425.21	1.02
16	600887	伊利股份	1,238,863	41,031,142.56	0.99
17	600104	上汽集团	2,507,223	38,360,511.90	0.92
18	601088	中国神华	2,499,354	36,340,607.16	0.87
19	601169	北京银行	4,001,938	32,255,620.28	0.78
20	601668	中国建筑	11,366,659	32,053,978.38	0.77
21	600383	金地集团	3,388,444	30,123,267.16	0.72
22	601006	大秦铁路	4,509,708	28,456,257.48	0.68
23	600015	华夏银行	3,374,378	27,669,899.60	0.67
24	000858	五粮液	1,438,207	25,787,051.51	0.62
25	601989	中国重工	5,259,095	25,348,837.90	0.61
26	000333	美的集团	1,277,487	24,681,048.84	0.59
27	600048	保利地产	4,870,871	24,159,520.16	0.58
28	600585	海螺水泥	1,516,853	23,844,929.16	0.57
29	600900	长江电力	3,749,722	23,323,270.84	0.56
30	600028	中国石化	4,257,469	22,436,861.63	0.54
31	601857	中国石油	2,947,656	22,225,326.24	0.53
32	002024	苏宁云商	3,358,031	22,028,683.36	0.53
33	000776	广发证券	2,244,900	22,000,020.00	0.53
34	600111	包钢稀土	1,100,626	21,627,300.90	0.52
35	600050	中国联通	6,429,736	20,768,047.28	0.50
36	000538	云南白药	394,395	20,587,419.00	0.50
37	600637	百视通	636,931	20,400,899.93	0.49
38	600089	特变电工	2,399,659	20,373,104.91	0.49
39	000063	中兴通讯	1,489,233	19,538,736.96	0.47
40	600276	恒瑞医药	567,384	18,814,453.44	0.45
41	600690	青岛海尔	1,237,418	18,264,289.68	0.44
42	600535	天士力	469,631	18,207,593.87	0.44
43	600011	华能国际	3,183,283	18,017,381.78	0.43
44	000895	双汇发展	500,337	17,907,061.23	0.43
45	600999	招商证券	1,760,878	17,802,476.58	0.43
46	000625	长安汽车	1,426,051	17,554,687.81	0.42
47	600196	复星医药	867,841	17,521,709.79	0.42
48	600518	康美药业	1,165,300	17,421,235.00	0.42
49	601888	中国国旅	515,459	17,030,765.36	0.41
50	002594	比亚迪	354,540	16,837,104.60	0.40
51	000725	京东方 A	7,714,063	16,739,516.71	0.40

52	600256	广汇能源	2,374,013	16,665,571.26	0.40
53	601766	中国南车	3,574,416	16,084,872.00	0.39
54	601688	华泰证券	2,120,288	15,944,565.76	0.38
55	600739	辽宁成大	1,035,178	15,765,760.94	0.38
56	601628	中国人寿	1,137,746	15,484,723.06	0.37
57	002415	海康威视	913,837	15,480,398.78	0.37
58	002241	歌尔声学	577,926	15,407,507.16	0.37
59	600018	上港集团	3,447,157	15,339,848.65	0.37
60	601901	方正证券	2,774,278	15,064,329.54	0.36
61	600019	宝钢股份	3,654,058	14,981,637.80	0.36
62	000157	中联重科	3,329,971	14,751,771.53	0.35
63	600406	国电南瑞	1,105,243	14,732,889.19	0.35
64	000338	潍柴动力	803,546	14,295,083.34	0.34
65	600795	国电电力	6,526,785	14,163,123.45	0.34
66	600703	三安光电	604,089	14,153,805.27	0.34
67	601299	中国北车	3,072,624	13,949,712.96	0.34
68	601390	中国中铁	5,187,576	13,383,946.08	0.32
69	601336	新华保险	631,558	13,344,820.54	0.32
70	000423	东阿阿胶	396,687	13,217,610.84	0.32
71	600886	国投电力	2,569,397	13,103,924.70	0.32
72	600352	浙江龙盛	810,118	13,083,405.70	0.31
73	600315	上海家化	356,874	13,079,432.10	0.31
74	601899	紫金矿业	5,991,499	13,061,467.82	0.31
75	000100	TCL 集团	5,725,626	13,054,427.28	0.31
76	002450	康得新	573,450	13,045,987.50	0.31
77	000069	华侨城 A	2,757,274	12,931,615.06	0.31
78	600832	东方明珠	1,173,172	12,881,428.56	0.31
79	601988	中国银行	4,976,604	12,690,340.20	0.31
80	601009	南京银行	1,575,817	12,606,536.00	0.30
81	600309	万华化学	819,743	12,427,303.88	0.30
82	002304	洋河股份	244,807	12,423,955.25	0.30
83	000581	威孚高科	450,426	12,147,989.22	0.29
84	600804	鹏博士	840,607	12,138,365.08	0.29
85	000783	长江证券	1,256,566	12,063,033.60	0.29
86	002236	大华股份	443,877	11,962,485.15	0.29
87	002353	杰瑞股份	291,198	11,720,719.50	0.28
88	600109	国金证券	588,068	11,684,911.16	0.28
89	600031	三一重工	2,311,060	11,647,742.40	0.28
90	002230	科大讯飞	425,373	11,314,921.80	0.27

91	002065	东华软件	557,044	11,207,725.28	0.27
92	002008	大族激光	640,125	11,099,767.50	0.27
93	002202	金风科技	1,163,046	11,037,306.54	0.27
94	600150	中国船舶	522,646	11,006,924.76	0.26
95	600010	包钢股份	3,034,563	10,985,118.06	0.26
96	600066	宇通客车	676,833	10,924,084.62	0.26
97	601186	中国铁建	2,335,912	10,768,554.32	0.26
98	600893	航空动力	412,609	10,632,933.93	0.26
99	000503	海虹控股	545,157	10,630,561.50	0.26
100	002456	欧菲光	493,863	10,583,484.09	0.25
101	000768	中航飞机	1,003,948	10,571,572.44	0.25
102	600600	青岛啤酒	263,281	10,547,036.86	0.25
103	600100	同方股份	1,166,636	10,394,726.76	0.25
104	601377	兴业证券	1,183,507	10,201,830.34	0.25
105	600332	白云山	406,043	10,106,410.27	0.24
106	600340	华夏幸福	401,417	10,103,665.89	0.24
107	000402	金融街	1,839,045	10,022,795.25	0.24
108	600583	海油工程	1,341,722	9,888,491.14	0.24
109	000009	中国宝安	951,452	9,714,324.92	0.23
110	601998	中信银行	2,251,934	9,615,758.18	0.23
111	600079	人福医药	321,222	9,588,476.70	0.23
112	000061	农产品	1,027,060	9,479,763.80	0.23
113	002081	金螳螂	667,768	9,455,594.88	0.23
114	600009	上海机场	729,552	9,411,220.80	0.23
115	000831	五矿稀土	446,385	9,365,157.30	0.23
116	002038	双鹭药业	208,011	9,271,050.27	0.22
117	000400	许继电气	458,669	9,196,313.45	0.22
118	600674	川投能源	779,843	9,155,356.82	0.22
119	600705	中航投资	566,688	9,106,676.16	0.22
120	601607	上海医药	729,550	9,068,306.50	0.22
121	600372	中航电子	399,851	9,064,622.17	0.22
122	600660	福耀玻璃	1,061,267	8,914,642.80	0.21
123	000963	华东医药	164,526	8,884,404.00	0.21
124	000039	中集集团	652,609	8,784,117.14	0.21
125	600718	东软集团	650,879	8,780,357.71	0.21
126	000826	桑德环境	383,917	8,772,503.45	0.21
127	600271	航天信息	419,475	8,754,443.25	0.21
128	000568	泸州老窖	529,188	8,668,099.44	0.21
129	600085	同仁堂	497,246	8,666,997.78	0.21

130	600839	四川长虹	2,800,242	8,624,745.36	0.21
131	002400	省广股份	350,100	8,605,458.00	0.21
132	600489	中金黄金	1,117,176	8,490,537.60	0.20
133	002465	海格通信	529,000	8,426,970.00	0.20
134	000623	吉林敖东	541,232	8,399,920.64	0.20
135	600547	山东黄金	540,194	8,362,203.12	0.20
136	600177	雅戈尔	1,183,513	8,320,096.39	0.20
137	600118	中国卫星	447,291	8,265,937.68	0.20
138	000562	宏源证券	1,004,041	8,253,217.02	0.20
139	000917	电广传媒	537,800	8,190,694.00	0.20
140	000024	招商地产	783,745	8,166,622.90	0.20
141	601991	大唐发电	2,267,848	8,073,538.88	0.19
142	002142	宁波银行	875,763	8,057,019.60	0.19
143	601669	中国电建	2,851,388	7,955,372.52	0.19
144	601168	西部矿业	1,447,478	7,917,704.66	0.19
145	601808	中海油服	448,193	7,883,714.87	0.19
146	601098	中南传媒	544,059	7,856,211.96	0.19
147	601933	永辉超市	1,235,684	7,809,522.88	0.19
148	601117	中国化学	1,496,055	7,794,446.55	0.19
149	600252	中恒集团	662,542	7,771,617.66	0.19
150	600362	江西铜业	629,065	7,718,627.55	0.19
151	601633	长城汽车	304,259	7,697,752.70	0.19
152	000970	中科三环	647,416	7,691,302.08	0.18
153	600741	华域汽车	784,702	7,674,385.56	0.18
154	601929	吉视传媒	667,164	7,632,356.16	0.18
155	002475	立讯精密	231,981	7,604,337.18	0.18
156	002410	广联达	284,784	7,529,688.96	0.18
157	600221	海南航空	4,483,021	7,486,645.07	0.18
158	600642	申能股份	1,722,060	7,439,299.20	0.18
159	000060	中金岭南	1,092,888	7,431,638.40	0.18
160	600597	光明乳业	463,175	7,429,327.00	0.18
161	600369	西南证券	854,167	7,303,127.85	0.18
162	000792	盐湖股份	483,071	7,279,879.97	0.18
163	002422	科伦药业	182,191	7,260,311.35	0.17
164	600649	城投控股	1,135,273	7,152,219.90	0.17
165	600867	通化东宝	544,100	7,089,623.00	0.17
166	600153	建发股份	1,288,875	7,024,368.75	0.17
167	000728	国元证券	743,520	7,018,828.80	0.17
168	600497	驰宏锌锗	756,483	6,967,208.43	0.17

169	000729	燕京啤酒	1,065,588	6,926,322.00	0.17
170	002385	大北农	607,941	6,906,209.76	0.17
171	000012	南玻A	994,352	6,791,424.16	0.16
172	000629	攀钢钒钛	3,253,149	6,766,549.92	0.16
173	601800	中国交建	1,785,237	6,712,491.12	0.16
174	601600	中国铝业	2,183,266	6,637,128.64	0.16
175	601018	宁波港	2,916,802	6,621,140.54	0.16
176	600549	厦门钨业	258,239	6,559,270.60	0.16
177	601333	广深铁路	2,577,206	6,546,103.24	0.16
178	600108	亚盛集团	1,183,696	6,545,838.88	0.16
179	600166	福田汽车	1,274,082	6,497,818.20	0.16
180	600068	葛洲坝	1,748,805	6,488,066.55	0.16
181	000598	兴蓉投资	1,359,352	6,484,109.04	0.16
182	601555	东吴证券	907,337	6,460,239.44	0.16
183	000425	徐工机械	937,674	6,423,066.90	0.15
184	600827	友谊股份	583,887	6,411,079.26	0.15
185	601618	中国中冶	3,696,098	6,320,327.58	0.15
186	000983	西山煤电	1,197,275	6,309,639.25	0.15
187	600588	用友软件	440,914	6,203,659.98	0.15
188	002570	贝因美	428,653	6,155,457.08	0.15
189	000778	新兴铸管	1,658,561	6,153,261.31	0.15
190	600029	南方航空	2,659,403	6,143,220.93	0.15
191	600873	梅花生物	1,177,926	6,042,760.38	0.15
192	600875	东方电气	503,523	5,976,818.01	0.14
193	000709	河北钢铁	3,210,041	5,970,676.26	0.14
194	000876	新希望	527,018	5,950,033.22	0.14
195	600516	方大炭素	619,469	5,940,707.71	0.14
196	000800	一汽轿车	617,158	5,924,716.80	0.14
197	600880	博瑞传播	498,536	5,902,666.24	0.14
198	002007	华兰生物	219,896	5,739,285.60	0.14
199	600060	海信电器	593,192	5,724,302.80	0.14
200	600648	外高桥	212,991	5,674,080.24	0.14
201	600267	海正药业	381,543	5,658,282.69	0.14
202	600655	豫园商城	764,810	5,629,001.60	0.14
203	601898	中煤能源	1,388,453	5,595,465.59	0.13
204	600316	洪都航空	327,055	5,589,369.95	0.13
205	601179	中国西电	1,557,800	5,561,346.00	0.13
206	600208	新潮中宝	1,900,304	5,548,887.68	0.13
207	600027	华电国际	1,806,276	5,545,267.32	0.13

208	600863	内蒙华电	1,463,048	5,515,690.96	0.13
209	601118	海南橡胶	893,980	5,489,037.20	0.13
210	600688	上海石化	1,656,707	5,450,566.03	0.13
211	000999	华润三九	296,289	5,448,754.71	0.13
212	000839	中信国安	713,420	5,421,992.00	0.13
213	601928	凤凰传媒	577,444	5,358,680.32	0.13
214	000686	东北证券	741,669	5,317,766.73	0.13
215	002344	海宁皮城	424,050	5,287,903.50	0.13
216	601699	潞安环能	695,728	5,280,575.52	0.13
217	002292	奥飞动漫	141,783	5,203,436.10	0.13
218	600415	小商品城	1,032,890	5,195,436.70	0.12
219	601958	金钼股份	734,266	5,183,917.96	0.12
220	600008	首创股份	832,528	5,145,023.04	0.12
221	002001	新和成	413,944	5,128,766.16	0.12
222	600348	阳泉煤业	908,768	5,125,451.52	0.12
223	600143	金发科技	1,162,203	5,125,315.23	0.12
224	002129	中环股份	266,608	5,084,214.56	0.12
225	601866	中海集运	2,402,094	5,068,418.34	0.12
226	002310	东方园林	304,946	5,034,658.46	0.12
227	000750	国海证券	524,706	4,958,471.70	0.12
228	002500	山西证券	761,697	4,943,413.53	0.12
229	600663	陆家嘴	309,302	4,899,343.68	0.12
230	000630	铜陵有色	538,562	4,825,515.52	0.12
231	601238	广汽集团	639,417	4,814,810.01	0.12
232	600436	片仔癀	61,002	4,729,485.06	0.11
233	601231	环旭电子	152,870	4,714,510.80	0.11
234	002375	亚厦股份	207,667	4,684,967.52	0.11
235	601992	金隅股份	821,048	4,614,289.76	0.11
236	600216	浙江医药	496,337	4,541,483.55	0.11
237	600664	哈药股份	724,377	4,505,624.94	0.11
238	600062	华润双鹤	260,510	4,478,166.90	0.11
239	002294	信立泰	149,030	4,473,880.60	0.11
240	000758	中色股份	449,415	4,467,185.10	0.11
241	600115	东方航空	1,930,068	4,458,457.08	0.11
242	600219	南山铝业	878,064	4,407,881.28	0.11
243	000960	锡业股份	347,679	4,325,126.76	0.10
244	000883	湖北能源	807,600	4,256,052.00	0.10
245	601111	中国国航	1,292,427	4,252,084.83	0.10
246	002106	莱宝高科	375,464	4,242,743.20	0.10

247	600498	烽火通信	346,001	4,120,871.91	0.10
248	000413	东旭光电	547,400	4,105,500.00	0.10
249	002146	荣盛发展	431,131	4,082,810.57	0.10
250	000878	云南铜业	531,114	4,041,777.54	0.10
251	600123	兰花科创	519,511	3,906,722.72	0.09
252	600895	张江高科	587,823	3,832,605.96	0.09
253	600157	永泰能源	1,603,272	3,799,754.64	0.09
254	002051	中工国际	234,222	3,794,396.40	0.09
255	002429	兆驰股份	485,900	3,760,866.00	0.09
256	600376	首开股份	846,646	3,657,510.72	0.09
257	601666	平煤股份	891,672	3,602,354.88	0.09
258	600259	广晟有色	94,068	3,596,219.64	0.09
259	601158	重庆水务	726,332	3,588,080.08	0.09
260	600170	上海建工	816,297	3,501,914.13	0.08
261	600058	五矿发展	323,966	3,417,841.30	0.08
262	000027	深圳能源	603,500	3,391,670.00	0.08
263	002399	海普瑞	181,247	3,385,693.96	0.08
264	000401	冀东水泥	409,286	3,327,495.18	0.08
265	600998	九州通	244,200	3,269,838.00	0.08
266	002653	海思科	163,862	3,146,150.40	0.08
267	600188	兖州煤业	450,347	3,116,401.24	0.07
268	002470	金正大	160,000	3,070,400.00	0.07
269	000937	冀中能源	525,390	3,063,023.70	0.07
270	601216	内蒙君正	289,300	3,046,329.00	0.07
271	002673	西部证券	274,236	2,961,748.80	0.07
272	000718	苏宁环球	615,705	2,776,829.55	0.07
273	600783	鲁信创投	168,238	2,701,902.28	0.06
274	600023	浙能电力	596,600	2,696,632.00	0.06
275	600546	山煤国际	752,372	2,693,491.76	0.06
276	601258	庞大集团	595,366	2,613,656.74	0.06
277	600809	山西汾酒	196,603	2,610,887.84	0.06
278	002603	以岭药业	84,827	2,495,610.34	0.06
279	000869	张裕 A	103,405	2,493,094.55	0.06
280	000536	华映科技	107,077	2,473,478.70	0.06
281	600096	云天化	343,445	2,414,418.35	0.06
282	000656	金科股份	349,511	2,408,130.79	0.06
283	600395	盘江股份	377,955	2,407,573.35	0.06
284	600633	浙报传媒	180,000	2,388,600.00	0.06
285	002416	爱施德	150,800	2,239,380.00	0.05

286	603699	纽威股份	113,425	2,208,384.75	0.05
287	601918	国投新集	781,554	2,180,535.66	0.05
288	600277	亿利能源	314,400	2,043,600.00	0.05
289	601139	深圳燃气	300,233	2,005,556.44	0.05
290	600403	大有能源	363,318	1,921,952.22	0.05
291	002269	美邦服饰	227,689	1,892,095.59	0.05
292	000961	中南建设	264,608	1,727,890.24	0.04
293	601225	陕西煤业	378,000	1,561,140.00	0.04
294	000156	华数传媒	53,238	1,495,455.42	0.04
295	603993	洛阳钼业	181,285	1,214,609.50	0.03

#### 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	600036	招商银行	16,899,064.42	0.39
2	601318	中国平安	14,511,495.05	0.33
3	600016	民生银行	13,049,016.18	0.30
4	600030	中信证券	11,521,274.10	0.27
5	002008	大族激光	10,883,037.92	0.25
6	000503	海虹控股	10,797,737.28	0.25
7	601166	兴业银行	8,784,957.07	0.20
8	002400	省广股份	8,371,188.48	0.19
9	002465	海格通信	8,021,670.20	0.18
10	000917	电广传媒	8,018,162.99	0.18
11	600000	浦发银行	7,930,616.60	0.18
12	601929	吉视传媒	7,870,774.30	0.18
13	601939	建设银行	7,843,472.00	0.18
14	002410	广联达	7,328,919.61	0.17
15	002475	立讯精密	7,292,342.28	0.17
16	600887	伊利股份	6,990,826.70	0.16
17	601989	中国重工	6,820,803.00	0.16
18	600867	通化东宝	6,814,841.48	0.16
19	000001	平安银行	6,674,158.24	0.15
20	000002	万科A	6,165,436.79	0.14

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	601318	中国平安	15,213,166.83	0.35
2	600016	民生银行	13,493,090.34	0.31
3	600036	招商银行	11,427,663.96	0.26
4	601166	兴业银行	9,032,617.34	0.21
5	600000	浦发银行	8,584,658.76	0.20
6	601939	建设银行	6,711,138.13	0.15
7	000002	万科A	6,117,899.99	0.14
8	600694	大商股份	6,087,806.09	0.14
9	600837	海通证券	6,007,248.83	0.14
10	000651	格力电器	5,654,297.10	0.13
11	601099	太平洋	5,409,769.46	0.12
12	600811	东方集团	5,282,959.89	0.12
13	600519	贵州茅台	5,062,542.31	0.12
14	601328	交通银行	4,783,111.83	0.11
15	000046	泛海控股	4,391,527.64	0.10
16	601601	中国太保	4,277,543.18	0.10
17	601989	中国重工	4,231,488.63	0.10
18	600160	巨化股份	3,932,912.79	0.09
19	600104	上汽集团	3,931,470.56	0.09
20	002155	辰州矿业	3,884,650.88	0.09

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	546,056,529.14
卖出股票收入（成交）总额	440,953,571.16

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	50,085,000.00	1.20

	其中：政策性金融债	50,085,000.00	1.20
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	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	50,085,000.00	1.20

#### 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	140212	14 国开 12	500,000	50,085,000.00	1.20

#### 7.7 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投资。

#### 7.8 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投资。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 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：

根据中国平安股票发行主体中国平安保险（集团）股份有限公司于 2013 年 5 月 21 日和 2013 年 10 月 14 日发布的公告，该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司（以下简称“万福生科”）发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。

在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	176,888.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	363,904.70
5	应收申购款	300,074,372.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,615,165.73

### 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

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

### 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

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
288,265	20,709.07	468,980,849.97	7.86%	5,500,720,625.58	92.14%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末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	273,405.04	0.005%

## 8.3 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（2006年4月6日）基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额	5,874,017,400.92
本报告期基金总申购份额	989,932,853.62
减：本报告期基金总赎回份额	894,248,778.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,969,701,475.55

## § 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

基金管理人于 2014 年 1 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五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成

基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

本报告期内没有涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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	
英大证券	1	359,065,206.91	36.54%	326,893.31	36.88%	-
光大证券	2	292,377,264.36	29.76%	262,164.41	29.58%	-
银河证券	4	127,650,937.72	12.99%	113,881.32	12.85%	-
长城证券	2	95,332,574.06	9.70%	86,791.21	9.79%	-
招商证券	2	65,103,846.59	6.63%	57,707.21	6.51%	-
国信证券	1	33,776,240.23	3.44%	30,750.05	3.47%	-
中信建投	3	9,229,217.89	0.94%	8,167.10	0.92%	-
国泰君安	2	12,749.00	0.00%	11.28	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：招商证券。

#### 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	大成基金管理有限公司关于增加和讯信息科技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	2014/1/4
2	大成沪深 300 指数证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/1/22
3	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	2014/1/25
4	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“雅戈尔”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/2/19
5	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/19
6	大成沪深 300 指数证券投资基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
7	大成沪深 300 指数证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/3/29
8	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/8
9	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/11
10	关于增加中国民族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	2014/4/17
11	大成沪深 300 指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/21
12	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“宇通客车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/4/22
13	大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/5/22
14	大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/5/22
15	关于增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/5
16	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014/6/30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 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。

### 11.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

### 11.3 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  
2014 年 8 月 28 日