

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 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：2015 年 8 月 27 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 2015 年 8 月 25 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 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 6 |
| 2.5 信息披露方式..... | 6 |
| 2.6 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 10 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 34 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 35 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 35 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细..... | 35 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.7 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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金融衍生品投资明细..... | 43 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... | 43 |

| | |
|---|-----------|
| 7.11 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 44 |
| 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 | 44 |
| §9 开放式基金份额变动 | 44 |
| §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 | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 45 |
| 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 | 47 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| §12 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 存放地点 | 49 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 大成纳斯达克 100 指数 QDII |
| 基金主代码 | 000834 |
| 交易代码 | 000834 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 13 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 | 16,068,063.12 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金可能将一定比例的基金资产投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。 |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 价格指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。 |

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 | 林葛 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95599 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京东城区建国门内大街 69 号 |

| | | |
|-------|---------------------------------|-------------------------------|
| 办公地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京复兴门内大街 28 号凯晨世 贸中心东座 9 层 |
| 邮政编码 | 518040 | 100031 |
| 法定代表人 | 刘卓 | 刘士余 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|---|
| 名称 | 英文 | The Bank of New York Mellon Corporation |
| | 中文 | 纽约梅隆银行股份有限公司 |
| 注册地址 | | One Wall Street New York, NY10286 |
| 办公地址 | | One Wall Street New York, NY10286 |
| 邮政编码 | | NY10286 |

2.5 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 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 大成基金管理有限公司 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商 银行大厦 32 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 8,201,837.04 |
| 本期利润 | 9,059,720.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0970 |
| 本期加权平均净值利润率 | 9.55% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.94% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 855,019.27 |

| | |
|---------------------|-------------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0532 |
| 期末基金资产净值 | 16,923,082.39 |
| 期末基金份额净值 | 1.053 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.30% |

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。

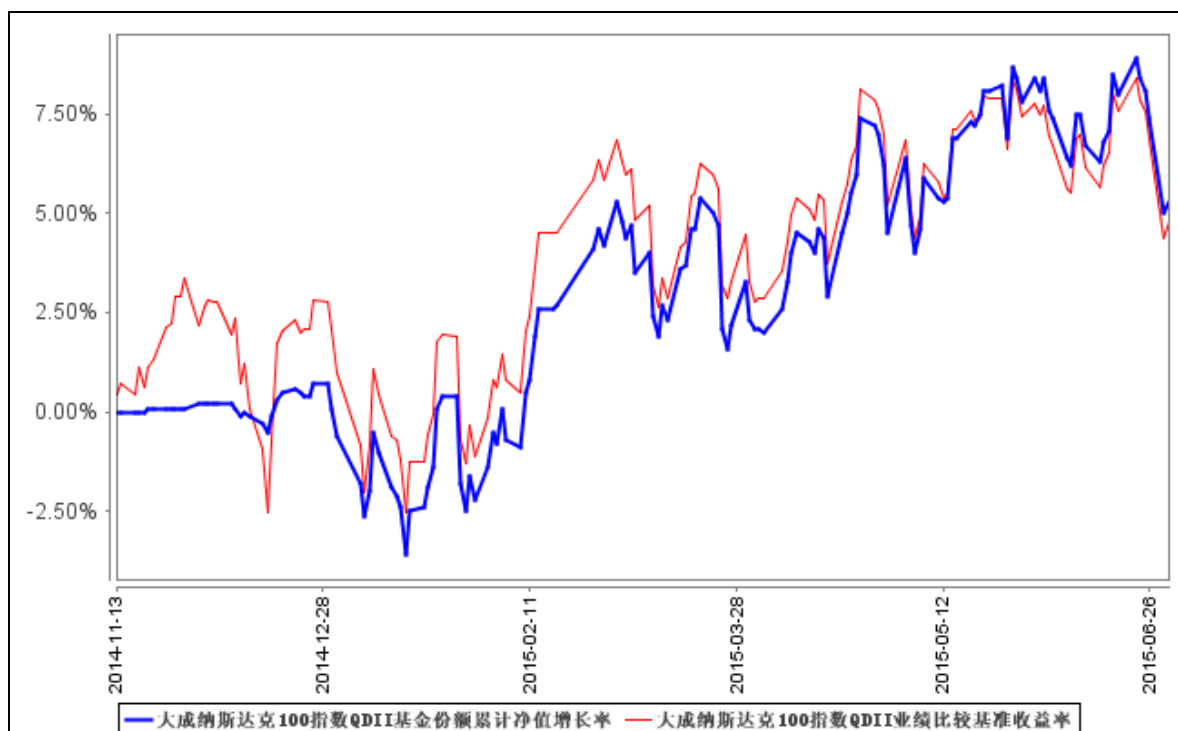
3.2 基金净值表现

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 | -2.32% | 0.79% | -2.47% | 0.81% | 0.15% | -0.02% |
| 过去三个月 | 2.93% | 0.82% | 1.46% | 0.84% | 1.47% | -0.02% |
| 过去六个月 | 5.94% | 0.87% | 3.79% | 0.93% | 2.15% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.30% | 0.77% | 4.80% | 0.91% | 0.50% | -0.14% |

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2015 年 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 51 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹

稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成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及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 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 | | |
| 冉凌浩先生 | 本基金基金经理 | 2014 年 11 月 13 日 | - | 12 年 | 金融学硕士。2003 年 4 月至 2004 年 6 月就职于国信证券研究部,任研究员;2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部,任高级研究员;2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司,历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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》、《大成纳斯达克 100 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，大成纳斯达克 100 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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些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。

4.4.2 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。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 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 1 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年,全球宏观经济保持了缓慢但相对稳定的增长,国际金融市场也相对稳定。

2015 年上半年,从欧洲方面来看,欧洲经济出现逐步复苏的迹象,因此欧元区的主要股票指数都有良好的表现。虽然在 2 季度的时候,希腊危机曾经重燃,希腊全民公投的结果更是将希腊退出欧元区风险进一步推高,但是最终希腊政府还是采取了向欧元区领导国妥协的政策,暂时平息了此次希腊危机。

2015 年上半年,美国经济增长略微偏弱。2015 年 1 季度的年化季环比 GDP 增长率为 0.6%,显著低于近 1 年的平均水平。1 季度宏观经济较弱的原因主要有(1)今年年初,美国出现严重的暴风雪天气,影响了经济活动;(2)美元短期内过强对美国净出口造成负面影响。

进入 2 季度,美国宏观经济增速有所恢复,2 季度的年化季环比 GDP 增长率为 2.3%,接近长期趋势水平。房屋销售和个人消费都是期内经济增长的重要引擎。

虽然上半年美国宏观经济表现相对较弱,但是美国科技企业创新发展依然迅猛,科技企业利润保持较快速度增长,所以本基金所跟踪的标的指数在期内取得了正收益。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨 3.79%,美元兑人民币中间价下跌 0.09%,经汇率调整后的目标指数上涨 3.70%。在本报告期内,本基金净值上涨 5.94%,高于经汇率调整后的目标指数 2.24%。

4.5.2 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 1.053 元,本报告期基金份额净值增长率为 5.94%,同期业绩比较基准收益率为 3.79%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望欧洲方面,欧洲的经济复苏仍然在持续,同时希腊政府已经妥协于欧元区主要领导国,希腊危机暂时平息,不会因此引发严重的金融危机。

从美国自身来看,虽然上半年经济增速放缓,但美国经济长期增长的逻辑不变,未来经济增

长潜力依然较大。个人消费和房地产市场有望持续成为经济增长的主要驱动力。

当前市场普遍预计美联储在四季度加息一次的可能性较大，主要理由是：（1）当前通胀无压力，美联储不急于加息；（2）短期经济数据表现一般。从历史实证分析来看，加息初期在不会对股票指数的长期业绩产生负面影响。

随着美国宏观经济恢复增长的动能，尤其是纳斯达克上市的科技企业凭借其全球科技领头羊的地位而保持较快的发展势头，本指数成分公司企业盈利也有望保持较快增长。

当前本基金所跟踪的标的指数的动态市盈率在 19 倍左右，仍然处于历史平均区间内。未来指数盈利的持续增加有望推动标的指数持续上涨。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好的跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 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—大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 761,761.57 | 94,954,076.38 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 15,951,401.34 | 137,874,558.32 |
| 其中：股票投资 | | 15,951,401.34 | 137,874,558.32 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 846,976.25 | |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 247.22 | 55,219.33 |
| 应收股利 | | 6,837.02 | 17,534.61 |
| 应收申购款 | | 122,738.50 | 210,683.72 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | 1,034,204.45 | |
| 资产总计 | | 18,724,166.35 | 233,112,072.36 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 29,830,872.31 |
| 应付赎回款 | | 1,595,994.75 | 5,405,223.90 |
| 应付管理人报酬 | | 12,931.67 | 157,000.22 |
| 应付托管费 | | 4,041.13 | 49,062.55 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 188,116.41 | 60,331.33 |
| 负债合计 | | 1,801,083.96 | 35,502,490.31 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 16,068,063.12 | 198,897,170.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 855,019.27 | -1,287,588.11 |
| 所有者权益合计 | | 16,923,082.39 | 197,609,582.05 |
| 负债和所有者权益总计 | | 18,724,166.35 | 233,112,072.36 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.053 元，基金份额总额 16,068,063.12 份。

6.2 利润表

会计主体：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|----------------------------|------------|---------------------------------|
| | | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 9,922,282.56 |
| 1. 利息收入 | | 63,585.71 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 63,578.49 |
| 债券利息收入 | | - |
| 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 | | 7.22 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 7,067,731.58 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 6,527,538.77 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 540,192.81 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 857,883.61 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 1,687,706.11 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 245,375.55 |
| 减：二、费用 | | 862,561.91 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.1.1 | 392,233.79 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.1.2 | 122,573.03 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 54,598.24 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.21 | 293,156.85 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 9,059,720.65 |

| | | |
|--------------------------|--|--------------|
| 减：所得税费用 | | |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 9,059,720.65 |

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 13 日，本报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止。截至报告日，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据，下同。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

| 项目 | 本期 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） | 198,897,170.16 | -1,287,588.11 | 197,609,582.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 9,059,720.65 | 9,059,720.65 |
| 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） | -182,829,107.04 | -6,917,113.27 | -189,746,220.31 |
| 其中：1. 基金申购款 | 6,278,437.53 | 271,911.67 | 6,550,349.20 |
| 2. 基金赎回款 | -189,107,544.57 | -7,189,024.94 | -196,296,569.51 |
| 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） | 16,068,063.12 | 855,019.27 | 16,923,082.39 |

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

基金管理人负责人

肖剑

主管会计工作负责人

范瑛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以

下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 656 号《关于核准大成纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 474,229,272.39 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 661 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 474,326,755.60 份基金份额,其中认购资金利息折合 97,483.21 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股,以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等。本基金还可以投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证,固定收益类证券(含中期票据)、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例占基金资产的 80%-95%,其中投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%-20%,其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:纳斯达克 100 价格指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计

入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期间无须说明其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- （1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- （2）目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。
- （3）目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 761,761.57 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 761,761.57 |

注：于 2015 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 463.74 元，折合人民币 2,835.12 元。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|---------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 15,404,891.46 | 15,951,401.34 | 546,509.88 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 15,404,891.46 | 15,951,401.34 | 546,509.88 |

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 247.22 |

| | |
|------------|--------|
| 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 | - |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 247.22 |

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 其他应收款 | 910,926.40 |
| 待摊费用 | 123,278.05 |
| 合计 | 1,034,204.45 |

6.4.7.7 应付交易费用

本基金于本期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 6,014.99 |
| 预提费用 | 182,101.42 |
| 合计 | 188,116.41 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 198,897,170.16 | 198,897,170.16 |
| 本期申购 | 6,278,437.53 | 6,278,437.53 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -189,107,544.57 | -189,107,544.57 |
| - 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 | 16,068,063.12 | 16,068,063.12 |
|-----|---------------|---------------|

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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 | -967,266.38 | -320,321.73 | -1,287,588.11 |
| 本期利润 | 8,201,837.04 | 857,883.61 | 9,059,720.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,043,016.01 | -1,874,097.26 | -6,917,113.27 |
| 其中：基金申购款 | 327,346.89 | -55,435.22 | 271,911.67 |
| 基金赎回款 | -5,370,362.90 | -1,818,662.04 | -7,189,024.94 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,191,554.65 | -1,336,535.38 | 855,019.27 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 29,578.49 |
| 定期存款利息收入 | 34,000.00 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 63,578.49 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 150,903,201.47 |
| 减：卖出股票成本总额 | 144,375,662.70 |
| 买卖股票差价收入 | 6,527,538.77 |

6.4.7.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 540,192.81 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 540,192.81 |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 857,883.61 |
| ——股票投资 | 857,883.61 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 857,883.61 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 245,375.55 |
| 合计 | 245,375.55 |

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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 54,598.24 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 54,598.24 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 26,232.33 |
| 信息披露费 | 148,767.52 |
| 银行汇划费 | 14,016.13 |
| 指数授权费 | 104,140.87 |
| 合计 | 293,156.85 |

注：指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.06% 的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 40,000.00 美元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆”) | 境外资产托管人 |
| 中泰信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 中国银河投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 广东证券股份有限公司(“广东证券”) | 基金管理人的股东 |
| 大成国际资产管理有限公司(“大成国际”) | 基金管理人的子公司 |
| 大成创新资本管理有限公司(“大成创新资 | 基金管理人的合营企业 |

本”)

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 392,233.79 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 181,320.17 |

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.8% / 当年天数。

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 122,573.03 |

注：支付基金托管人中国农行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.3.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|--------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 |
| 纽约梅隆 | 2,493.49 | - | - | - |
| 中国农行 | 759,268.08 | 29,578.49 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农行和境外资产托管人纽约梅隆保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本报告期内本基金无利润分配事项。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行及境外次托管行纽约梅隆，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2015年6月30日，本基金未持有信用类债券(2014年12月31日：同)。

6.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015年6月30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 | 761,761.57 | - | - | - | 761,761.57 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 15,951,401.34 | 15,951,401.34 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 846,976.25 | 846,976.25 |
| 应收利息 | - | - | - | 247.22 | 247.22 |
| 应收股利 | - | - | - | 6,837.02 | 6,837.02 |
| 应收申购款 | 4,273.99 | - | - | 118,464.51 | 122,738.50 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,034,204.45 | 1,034,204.45 |
| 资产总计 | 766,035.56 | - | - | 17,958,130.79 | 18,724,166.35 |

| | | | | | |
|-------------------------|---------------|-----------------|--------------|----------------|----------------|
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,595,994.75 | 1,595,994.75 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 12,931.67 | 12,931.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,041.13 | 4,041.13 |
| 其他负债 | - | - | - | 188,116.41 | 188,116.41 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,801,083.96 | 1,801,083.96 |
| 利率敏感度缺口 | 766,035.56 | - | - | 16,157,046.83 | 16,923,082.39 |
| 上年度末 | | | | | |
| 2014 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 | 94,954,076.38 | - | - | - | 94,954,076.38 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 137,874,558.32 | 137,874,558.32 |
| 应收利息 | - | - | - | 2 | 55,219.33 |
| 应收股利 | - | - | - | 55,219.33 | 17,534.61 |
| 应收申购款 | 1,988.07 | - | - | 208,695.65 | 210,683.72 |
| 资产总计 | 94,956,064.45 | - | - | 138,156,007.91 | 233,112,072.36 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 29,830,872.31 | 29,830,872.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,405,223.90 | 5,405,223.90 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 157,000.22 | 157,000.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | 49,062.55 | 49,062.55 |
| 其他负债 | - | - | - | 60,331.33 | 60,331.33 |
| 负债总计 | - | - | - | 35,502,490.31 | 35,502,490.31 |
| 利率敏感度缺口 | 94,956,064.45 | - | - | 102,653,517.60 | 197,609,582.05 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日本基金未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|--------------------------|-------------|---------------|----------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 2,835.12 | - | - | 2,835.12 |
| 交易性金融资产 | 15,951,401.34 | - | - | 15,951,401.34 |
| 应收股利 | 6,837.02 | - | - | 6,837.02 |
| 应收利息 | 19.56 | - | - | 19.56 |
| 应收证券清算款 | 846,976.25 | - | - | 846,976.25 |
| 其它资产 | 1,034,204.45 | - | - | 1,034,204.45 |
| 资产合计 | 17,842,273.74 | - | - | 17,842,273.74 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 17,842,273.74 | - | - | 17,842,273.74 |
| 项目 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 30,741,485.07 | - | - | 30,741,485.07 |
| 交易性金融资产 | 137,874,558.32 | - | - | 137,874,558.32 |
| 应收股利 | 17,534.61 | - | - | 17,534.61 |
| 资产合计 | 168,633,578.00 | - | - | 168,633,578.00 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | 29,830,872.31 | - | - | 29,830,872.31 |
| 其它负债 | 32,858.48 | - | - | 32,858.48 |
| 负债合计 | 29,863,730.79 | - | - | 29,863,730.79 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 138,769,847.21 | - | - | 138,769,847.21 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除美元以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|------------------------------|------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元) | |
| | | 本期末 | 上年度末 |

| | | | |
|--|--------------|-----------------|------------------|
| | | 2015 年 6 月 30 日 | 2014 年 12 月 31 日 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 增加约 84 | 增加约 694 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | 减少约 84 | 减少约 694 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于以纳斯达克 100 指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%-20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2014 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 | 15,951,401.34 | 94.26 | 137,874,558.32 | 69.77 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |

| | | | | |
|----|---------------|-------|----------------|-------|
| 其他 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 合计 | 15,951,401.34 | 94.26 | 137,874,558.32 | 69.77 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----------------|----------------------|------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元) | |
| | | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 增加约 78 | 增加约 161 |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | 减少约 78 | 减少约 161 | |

6.4.14 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 | 15,951,401.34 | 85.19 |
| | 其中: 普通股票 | 15,951,401.34 | 85.19 |
| | 存托凭证 | - | 0.00 |
| | 优先股 | - | 0.00 |
| | 房地产信托凭证 | - | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | - | 0.00 |
| 3 | 固定收益投资 | - | 0.00 |
| | 其中: 债券 | - | 0.00 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 |
| | 其中: 远期 | - | 0.00 |
| | 期货 | - | 0.00 |
| | 期权 | - | 0.00 |
| | 权证 | - | 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 | 货币市场工具 | - | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 761,761.57 | 4.07 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,011,003.44 | 10.74 |

| | | | |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 18,724,166.35 | 100.00 |
|---|----|---------------|--------|

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家(地区) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|--------|---------------|--------------|
| 美国 | 15,951,401.34 | 94.26 |
| 合计 | 15,951,401.34 | 94.26 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 金融 | - | 0.00 |
| 消费者非必需品 | 3,144,470.93 | 18.58 |
| 信息技术 | 8,807,553.86 | 52.04 |
| 工业 | 329,224.27 | 1.95 |
| 医疗保健 | 2,491,086.45 | 14.72 |
| 能源 | - | 0.00 |
| 消费者常用品 | 1,003,360.54 | 5.93 |
| 公用事业 | - | 0.00 |
| 基础材料 | 51,967.74 | 0.31 |
| 电信服务 | 123,737.55 | 0.73 |
| 合计 | 15,951,401.34 | 94.26 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------|------------|---------|---------|----------|----------|--------------|--------------|
| 1 | Apple Inc. | 苹果公司 | AAPL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,983.00 | 2,287,359.30 | 13.52 |
| 2 | Microsoft Corp | 微软 | MSFT UQ | 纳斯达克交易所 | US | 4,189.00 | 1,130,675.78 | 6.68 |
| 3 | Amazon.com Inc | 亚马逊公司 | AMZN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 241.00 | 639,578.48 | 3.78 |
| 4 | Facebook Inc | Facebook 公 | FB UQ | 纳斯达克 | US | 1,164.0 | | |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|-----------------------------|----------|---------|----|----------|------------|------|
| | | 司 | | 交易所 | | 0 | 610,323.50 | 3.61 |
| 5 | Google Inc C | 谷歌公司 | GOOG UQ | 纳斯达克交易所 | US | 177.00 | 563,247.62 | 3.33 |
| 6 | Gilead Sciences Inc | 吉利德科学 | GILD UQ | 纳斯达克交易所 | US | 761.00 | 544,708.80 | 3.22 |
| 7 | Google Inc A | 谷歌公司 | GOOGL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 149.00 | 491,936.69 | 2.91 |
| 8 | Intel Corp | 英特尔公司 | INTC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,457.00 | 456,867.25 | 2.70 |
| 9 | Cisco Systems Inc | 思科 | CSCO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,634.00 | 442,194.49 | 2.61 |
| 10 | Comcast Corp | 康卡斯特 | CMCSA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,099.00 | 404,071.42 | 2.39 |
| 11 | Amgen Inc | 安进 | AMGN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 393.00 | 368,854.03 | 2.18 |
| 12 | QUALCOMM Inc | 高通公司 | QCOM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 844.00 | 323,163.18 | 1.91 |
| 13 | Biogen Inc | 百健 | BIIB UQ | 纳斯达克交易所 | US | 121.00 | 298,812.84 | 1.77 |
| 14 | Walgreens Boots Alliance Inc | Walgreens Boots Alliance 公司 | WBA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 564.00 | 291,155.06 | 1.72 |
| 15 | Celgene Corp | 新基医药 | CELG UQ | 纳斯达克交易所 | US | 410.00 | 290,098.57 | 1.71 |
| 16 | Starbucks Corp | 星巴克 | SBUX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 777.00 | 254,685.61 | 1.50 |
| 17 | eBay Inc. | 电子湾 | EBAY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 629.00 | 231,650.17 | 1.37 |
| 18 | Mondelez International Inc | Mondelez 国际公司 | MDLZ UQ | 纳斯达克交易所 | US | 842.00 | 211,774.37 | 1.25 |
| 19 | Express Scripts Holding Co. | 快捷药方 | ESRX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 377.00 | 204,991.33 | 1.21 |
| 20 | Costco Wholesale Corp | 好市多批发 | COST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 227.00 | 187,434.54 | 1.11 |
| 21 | The Priceline Group Inc | Priceline 集团 | PCLN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 26.00 | 183,014.41 | 1.08 |
| 22 | BAIDU INC - SPON ADR | 百度 | BIDU UQ | 纳斯达克交易所 | US | 143.00 | 174,044.65 | 1.03 |
| 23 | Texas Instruments Inc | 德州仪器 | TXN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 538.00 | 169,422.41 | 1.00 |
| 24 | Regeneron Pharmaceuticals | 再生元制药股份有限公司 | REGN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 52.00 | 162,174.00 | 0.96 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------------|-------------------|----------|---------|----|--------|------------|------|
| | Inc | 司 | | | | | | |
| 25 | Kraft Foods Group Inc. | 卡夫食品集团股份有限公司 | KRFT UQ | 纳斯达克交易所 | US | 306.00 | 159,276.64 | 0.94 |
| 26 | DIRECTV | DIRECTV 公司 | DTV UQ | 纳斯达克交易所 | US | 261.00 | 148,060.33 | 0.87 |
| 27 | Twenty-First Century Fox, Inc | 新闻集团 | FOXA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 652.00 | 129,726.56 | 0.77 |
| 28 | Adobe Systems Inc | 奥多比 | ADBE UQ | 纳斯达克交易所 | US | 259.00 | 128,273.05 | 0.76 |
| 29 | NetFlix Inc | 奈飞公司 | NFLX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 31.00 | 124,504.32 | 0.74 |
| 30 | Automatic Data Processing | ADP 公司 | ADP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 243.00 | 119,190.07 | 0.70 |
| 31 | Cognizant Tech Solutions Corp | 高知特科技公司 | CTSH UQ | 纳斯达克交易所 | US | 316.00 | 118,019.62 | 0.70 |
| 32 | Yahoo Inc | 雅虎 | YHOO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 486.00 | 116,738.83 | 0.69 |
| 33 | Alexion Pharmaceuticals Inc | Alexion 制药公司 | ALXN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 103.00 | 113,831.01 | 0.67 |
| 34 | Avago Technologies Ltd | 安华高科技公司 | AVGO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 132.00 | 107,273.87 | 0.63 |
| 35 | TESLA MOTORS INC | 特斯拉汽车公司 | TSLA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 65.00 | 106,602.23 | 0.63 |
| 36 | Mylan NV | 迈兰公司 | MYL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 253.00 | 104,961.83 | 0.62 |
| 37 | LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | LIBERTY GLOBAL 公司 | LBTYK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 320.00 | 99,050.10 | 0.59 |
| 38 | ILLUMINA INC | ILLUMINA 公司 | ILMN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 74.00 | 98,787.46 | 0.58 |
| 39 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 维特制药股份有限公司 | VRTX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 126.00 | 95,118.32 | 0.56 |
| 40 | Broadcom Corp A | Broadcom 公司 | BRCM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 286.00 | 90,029.73 | 0.53 |
| 41 | Intuit Inc | Intuit 公司 | INTU UQ | 纳斯达克交易所 | US | 142.00 | 87,481.58 | 0.52 |
| 42 | American Airlines Group Inc. | 美国航空集团公司 | AAL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 358.00 | 87,404.49 | 0.52 |
| 43 | TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 新闻集团 | FOX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 413.00 | 81,352.82 | 0.48 |
| 44 | NXP | 恩智浦半导 | NXPI UQ | 纳斯达克 | US | 130.00 | | |

| | | | | | | | | |
|----|---------------------------------|-------------------------------|-------------|-------------|----|--------------|-----------|------|
| | SEMICONDUCTORS NV | 体 | | 交易所 | | | 78,046.22 | 0.46 |
| 45 | Cerner Corp | 塞纳公司 | CERN UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 178.00 | 75,152.53 | 0.44 |
| 46 | Applied Materials Inc | 应用材料 | AMAT UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 637.00 | 74,849.66 | 0.44 |
| 47 | COMCAST CORP-SPECIAL CL A | 康卡斯特 | CMCSK UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 197.00 | 72,190.49 | 0.43 |
| 48 | Monster Beverage Corp New | Monster Beverage Corp | MNST UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 88.00 | 72,102.33 | 0.43 |
| 49 | O'Reilly Automotive | O'Reilly 汽车股份有 限公司 | ORLY UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 52.00 | 71,840.67 | 0.42 |
| 50 | PACCAR Inc | 帕卡 | PCAR UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 183.00 | 71,389.91 | 0.42 |
| 51 | Viacom Inc B | 维亚康姆公 司 | VIAB UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 179.00 | 70,737.78 | 0.42 |
| 52 | Electronic Arts | 电子艺界 | EA UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 162.00 | 65,861.81 | 0.39 |
| 53 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | SIRIUS XM 公 司 | SIRI UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 2,834.0 0 | 64,625.77 | 0.38 |
| 54 | Marriott Intl A | 万豪国际 | MAR UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 142.00 | 64,580.28 | 0.38 |
| 55 | Micron Technology Inc | 美光技术 | MU UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 560.00 | 64,500.93 | 0.38 |
| 56 | Ross Stores Inc | Ross 商店 有限公司 | ROST UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 214.00 | 63,596.97 | 0.38 |
| 57 | Analog Devices Inc | 模拟器件 | ADI UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 162.00 | 63,569.03 | 0.38 |
| 58 | Fiserv Inc | Fiserv 公司 | FISV UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 122.00 | 61,779.52 | 0.37 |
| 59 | CHARTER COMMUNICATION-A | 特许通讯公 司 | CHTR UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 58.00 | 60,723.33 | 0.36 |
| 60 | Western Digital Corp | 西部数据公 司 | WDC UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 119.00 | 57,051.99 | 0.34 |
| 61 | Intuitive Surgical Inc | 直觉外科手 术公司 | ISRG UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 19.00 | 56,278.74 | 0.33 |
| 62 | ACTIVISION BLIZZARD INC | ACTIVISION BLIZZARD 公 司 | ATVI UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 376.00 | 55,651.86 | 0.33 |
| 63 | Paychex Inc | Paychex 公 司 | PAYX UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 188.00 | 53,881.85 | 0.32 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|------------------------|----------|---------|----|--------|-----------|------|
| 64 | Sigma-Aldrich Corp | 西格玛-奥德里奇 | SIAL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 61.00 | 51,967.74 | 0.31 |
| 65 | Dollar Tree Inc | Dollar Tree 公司 | DLTR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 106.00 | 51,188.81 | 0.30 |
| 66 | Symantec Corp | 赛门铁克 | SYMC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 352.00 | 50,033.70 | 0.30 |
| 67 | VODAFONE GROUP PLC-SP ADR | 沃达丰集团 | VOD UQ | 纳斯达克交易所 | US | 220.00 | 49,024.96 | 0.29 |
| 68 | Altera Corp | Altera 公司 | ALTR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 155.00 | 48,517.53 | 0.29 |
| 69 | DISH NETWORK CORP-A | DISH NETWORK 公司 | DISH UQ | 纳斯达克交易所 | US | 116.00 | 48,018.42 | 0.28 |
| 70 | Seagate Technology | 希捷科技公司 | STX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 164.00 | 47,624.94 | 0.28 |
| 71 | SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | SBA 通信公司 | SBAC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 67.00 | 47,093.00 | 0.28 |
| 72 | CHECK POINT SOFTWARE TECH | CHECK POINT 软件科技 | CHKP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 93.00 | 45,229.33 | 0.27 |
| 73 | Whole Foods Market Inc | 全食超市 | WFM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 185.00 | 44,607.27 | 0.26 |
| 74 | LIBERTY GLOBAL PLC-A | LIBERTY GLOBAL 公司 | LBTYA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 130.00 | 42,973.11 | 0.25 |
| 75 | Lam Research Corp | Lam Research 公司 | LRCX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 82.00 | 40,781.99 | 0.24 |
| 76 | CA Inc | 冠群国际 | CA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 227.00 | 40,648.29 | 0.24 |
| 77 | CATAMARAN CORP | CATAMARAN 公司 | CTRX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 107.00 | 39,955.80 | 0.24 |
| 78 | Akamai Technologies Inc | 阿卡迈技术公司 | AKAM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 92.00 | 39,270.34 | 0.23 |
| 79 | Fastenal Co | 快扣公司 | FAST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 152.00 | 39,196.49 | 0.23 |
| 80 | LIBERTY INTERACTIVE CORP-A | LIBERTY INTERACTIVE 公司 | QVCA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 229.00 | 38,850.40 | 0.23 |
| 81 | VERISK ANALYTICS INC-CLASS A | VERISK ANALYTICS 公司 | VRSK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 87.00 | 38,699.82 | 0.23 |
| 82 | Tractor Supply Co | Tractor Supply 公司 | TSCO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 70.00 | 38,490.00 | 0.23 |
| 83 | SanDisk Corp | SanDisk Corp | SNDK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 107.00 | 38,084.92 | 0.23 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------|--------------------------|----------|---------|----|--------|-----------|------|
| 84 | Schein Henry Inc | 汉瑞祥公司 | HSIC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 43.00 | 37,361.19 | 0.22 |
| 85 | Bed Bath & Beyond Inc | Bed Bath & Beyond | BBBY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 88.00 | 37,111.02 | 0.22 |
| 86 | Keurig Green Mountain Inc | Keurig Green Mountain 公司 | GMCR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 79.00 | 37,010.33 | 0.22 |
| 87 | Stericycle Inc | Stericycle 公司 | SRCL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 44.00 | 36,021.58 | 0.21 |
| 88 | Xilinx Inc | 赛灵思 | XLNX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 133.00 | 35,906.88 | 0.21 |
| 89 | Autodesk Inc | 欧特克 | ADSK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 117.00 | 35,818.24 | 0.21 |
| 90 | TripAdvisor Inc. | TripAdvisor 公司 | TRIP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 67.00 | 35,693.52 | 0.21 |
| 91 | Citrix Systems Inc | 思杰系统 | CTXS UQ | 纳斯达克交易所 | US | 83.00 | 35,601.20 | 0.21 |
| 92 | Nvidia Corp | NVIDIA 公司 | NVDA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 278.00 | 34,178.57 | 0.20 |
| 93 | Linear Technology Corp | 凌特 | LLTC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 124.00 | 33,530.16 | 0.20 |
| 94 | Wynn Resorts Ltd | 永利度假村有限公司 | WYNN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 52.00 | 31,367.90 | 0.19 |
| 95 | NetApp Inc | 网域存储技术 | NTAP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 161.00 | 31,064.18 | 0.18 |
| 96 | Staples Inc | 史泰博公司 | SPLS UQ | 纳斯达克交易所 | US | 331.00 | 30,981.34 | 0.18 |
| 97 | CH Robinson Worldwide Inc | 罗宾逊全球物流有限公司 | CHRW UQ | 纳斯达克交易所 | US | 75.00 | 28,607.06 | 0.17 |
| 98 | KLA-Tencor Corporation | Kla-Tencor 公司 | KLAC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 82.00 | 28,178.93 | 0.17 |
| 99 | Expeditors Intl of WA Inc | 华盛顿康捷国际物流公司 | EXPD UQ | 纳斯达克交易所 | US | 99.00 | 27,904.92 | 0.16 |
| 100 | VIMPELCOM LTD-SPON ADR | VIMPELCOM 公司 | VIP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 909.00 | 27,619.59 | 0.16 |
| 101 | Mattel Inc | 美泰 | MAT UQ | 纳斯达克交易所 | US | 175.00 | 27,485.22 | 0.16 |
| 102 | Discovery Communications Inc C | 探索传播公司 | DISCK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 142.00 | 26,981.52 | 0.16 |
| 103 | Garmin Ltd | 佳明有限公 | GRMN UQ | 纳斯达克 | US | 99.00 | | |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------------|----------------------------|-------------|-------------|----|--------|-----------|------|
| | | 司 | | 交易所 | | | 26,588.47 | 0.16 |
| 104 | LIBERTY MEDIA CORP - C | LIBERTY MEDIA 公司 | LMCK UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 117.00 | 25,678.95 | 0.15 |
| 105 | LIBERTY VENTURES - SER A | LIBERTY VENTURES 公 司 | LVNTA UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 69.00 | 16,565.59 | 0.10 |
| 106 | Discovery Communications Inc A | 探索传播公 司 | DISCA UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 77.00 | 15,657.05 | 0.09 |
| 107 | LIBERTY MEDIA CORP - A | LIBERTY MEDIA 公司 | LMCA UQ | 纳斯达克 交易所 | US | 54.00 | 11,898.04 | 0.07 |

7.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金 资产净值比 例(%) |
|----|---------------------------------|----------|--------------|------------------------|
| 1 | Facebook Inc | FB UQ | 1,307,061.56 | 0.66 |
| 2 | Walgreens Boots Alliance Inc | WBA UQ | 1,240,637.02 | 0.63 |
| 3 | Biogen Inc | BIIB UQ | 1,238,152.50 | 0.63 |
| 4 | Gilead Sciences Inc | GILD UQ | 1,149,308.35 | 0.58 |
| 5 | Google Inc A | GOOGL UQ | 1,111,116.19 | 0.56 |
| 6 | Cisco Systems Inc | CSCO UQ | 1,070,583.93 | 0.54 |
| 7 | Amazon.com Inc | AMZN UQ | 1,059,613.41 | 0.54 |
| 8 | eBay Inc. | EBAY UQ | 1,031,403.20 | 0.52 |
| 9 | QUALCOMM Inc | QCOM UQ | 941,833.19 | 0.48 |
| 10 | BAIDU INC | BIDU UQ | 939,002.87 | 0.48 |
| 11 | Amgen Inc | AMGN UQ | 915,630.22 | 0.46 |
| 12 | Comcast Corp | CMCSA UQ | 911,793.74 | 0.46 |
| 13 | Celgene Corp | CELG UQ | 693,813.40 | 0.35 |
| 14 | Starbucks Corp | SBUX UQ | 681,671.92 | 0.34 |
| 15 | Costco Wholesale Corp | COST UQ | 482,921.52 | 0.24 |
| 16 | Express Scripts Holding Co. | ESRX UQ | 475,591.61 | 0.24 |
| 17 | Mondelez International Inc | MDLZ UQ | 475,090.00 | 0.24 |

| | | | | |
|----|----------------------------------|---------|------------|------|
| 18 | The Priceline Group Inc | PCLN UQ | 427,563.57 | 0.22 |
| 19 | Texas Instruments Inc | TXN UQ | 426,063.34 | 0.22 |
| 20 | Twenty-First Century Fox, Inc | FOXA UQ | 370,771.13 | 0.19 |

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金 资产净值比 例(%) |
|----|--------------------------------|----------|---------------|------------------------|
| 1 | Apple Inc. | AAPL UQ | 19,323,382.85 | 9.78 |
| 2 | Microsoft Corp | MSFT UQ | 9,281,401.08 | 4.70 |
| 3 | Amazon.com Inc | AMZN UQ | 6,043,948.90 | 3.06 |
| 4 | Facebook Inc | FB UQ | 6,034,171.81 | 3.05 |
| 5 | Google Inc A | GOOGL UQ | 5,338,577.56 | 2.70 |
| 6 | Gilead Sciences Inc | GILD UQ | 5,231,693.09 | 2.65 |
| 7 | Cisco Systems Inc | CSCO UQ | 4,924,712.42 | 2.49 |
| 8 | Google Inc C | GOOG UQ | 4,824,826.18 | 2.44 |
| 9 | Comcast Corp | CMCSA UQ | 4,232,250.16 | 2.14 |
| 10 | Amgen Inc | AMGN UQ | 4,096,544.98 | 2.07 |
| 11 | Intel Corp | INTC UQ | 4,003,509.08 | 2.03 |
| 12 | QUALCOMM Inc | QCOM UQ | 3,895,175.80 | 1.97 |
| 13 | Biogen Inc | BIIB UQ | 3,286,457.27 | 1.66 |
| 14 | Celgene Corp | CELG UQ | 3,172,633.23 | 1.61 |
| 15 | Starbucks Corp | SBUX UQ | 2,642,913.10 | 1.34 |
| 16 | eBay Inc. | EBAY UQ | 2,432,692.47 | 1.23 |
| 17 | Costco Wholesale Corp | COST UQ | 2,166,938.39 | 1.10 |
| 18 | The Priceline Group Inc | PCLN UQ | 2,117,649.54 | 1.07 |
| 19 | Express Scripts Holding Co. | ESRX UQ | 2,095,079.54 | 1.06 |
| 20 | Mondelez International Inc | MDLZ UQ | 2,072,348.84 | 1.05 |

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 21,594,622.11 |
| 卖出收入（成交）总额 | 150,903,201.47 |

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.11.2 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股票。

7.11.3 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 | 应收证券清算款 | 846,976.25 |
| 3 | 应收股利 | 6,837.02 |
| 4 | 应收利息 | 247.22 |
| 5 | 应收申购款 | 122,738.50 |
| 6 | 其他应收款 | 910,926.40 |
| 7 | 待摊费用 | 123,278.05 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,011,003.44 |

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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 |
| 839 | 19,151.45 | 230,315.53 | 1.43% | 15,837,747.59 | 98.57% |

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 | 218,493.88 | 1.3598% |

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 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014年11月13日）基金份额总额 | 474,326,755.60 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 198,897,170.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,278,437.53 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 189,107,544.57 |
| 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 | 16,068,063.12 |

§ 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

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司副总经理。

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普华永道中天会计师事务所（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

本报告期内，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 | |
| 摩根士丹利 | 1 | 172,497,823.58 | 100.00% | 51,749.53 | 100.00% | - |

注：1、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，本公司制定了租用境内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。

2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度（包括但不限于公平交易制度及保密制度），能满足各投资组合运作高度保密的要求；

(五) 证券研究或市场研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务, 并能根据各投资组合投资的特定要求, 提供专题研究报告;

(六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

(七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

(八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

(九) 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。

交易管理部在每半年 15 个交易日内, 汇总上半年境外券商综合服务评价结果, 作为当次境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划, 报部门及公司分管领导批准;

交易量分配计划获批后, 作为选择交易券商的依据, 供交易员在交易时进行券商选择。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时, 及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作, 并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括: 长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、申银万国、中银国际、东莞证券、渤海证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券、华福证券、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无退租或新增的境内交易单元, 无新增或退租境外交易单元。

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高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/13 |
| 2 | 大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统 | 中国证监会指定报 | 2015/1/14 |

| | | | |
|----|--|-----------------|-----------|
| | 升级暂停服务的公告 | 刊及本公司网站 | |
| 3 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/15 |
| 4 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑） | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/22 |
| 5 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远） | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/22 |
| 6 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/24 |
| 7 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/24 |
| 8 | 大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/28 |
| 9 | 大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/1/30 |
| 10 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/2/14 |
| 11 | 大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/2 |
| 12 | 关于大成纳斯达克 100 指数证券投资基金增加华宝证券有限责任公司为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/3 |
| 13 | 大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/13 |
| 14 | 大成基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/25 |
| 15 | 大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/28 |
| 16 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/3/31 |
| 17 | 大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购、申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/4/14 |
| 18 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/4/18 |
| 19 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/5 |
| 20 | 大成基金管理有限公司关于大成纳斯达克 100 指数型证券投资基金增加光大银行为代销机构的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/8 |
| 21 | 大成基金管理有限公司关于调整网上直销通联支付交易费率的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/8 |
| 22 | 关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/15 |
| 23 | 大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/16 |

| | | | |
|----|---|-----------------|-----------|
| 24 | 大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/19 |
| 25 | 大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/5/21 |
| 26 | 关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/6/24 |
| 27 | 大成纳斯达克 100 指数基金更新招募说明书 (2015 年 1 期) | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/6/26 |
| 28 | 大成纳斯达克 100 指数基金更新招募说明书摘要 (2015 年 1 期) | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2015/6/26 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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纳斯达克 100 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成纳斯达克 100 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

本期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。

大成基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日