

大成沪深 300 指数证券投资基金  
2015 年年度报告  
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
<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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	19
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.3 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 .....	53
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 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	1,928,620,557.68 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	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 F9
邮政编码		518040	100031

法定代表人	刘卓	刘士余
-------	----	-----

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行托管业务部

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	2,201,947,700.72	-87,844,188.51	-356,732,659.04
本期利润	889,703,346.36	1,895,047,973.47	-202,152,150.38
加权平均基金份额本期利润	0.2990	0.3373	-0.0308
本期加权平均净值利润率	24.30%	44.72%	-4.02%
本期基金份额净值增长率	7.99%	49.51%	-5.51%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	371,276,965.28	-202,255,740.12	-1,535,359,674.02
期末可供分配基金份额利润	0.1925	-0.0373	-0.2614
期末基金资产净值	2,299,897,522.96	5,982,844,808.22	4,338,657,726.90
期末基金份额净值	1.1925	1.1043	0.7386
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	190.08%	168.62%	79.66%

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

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为

期末余额，不是当期发生数)

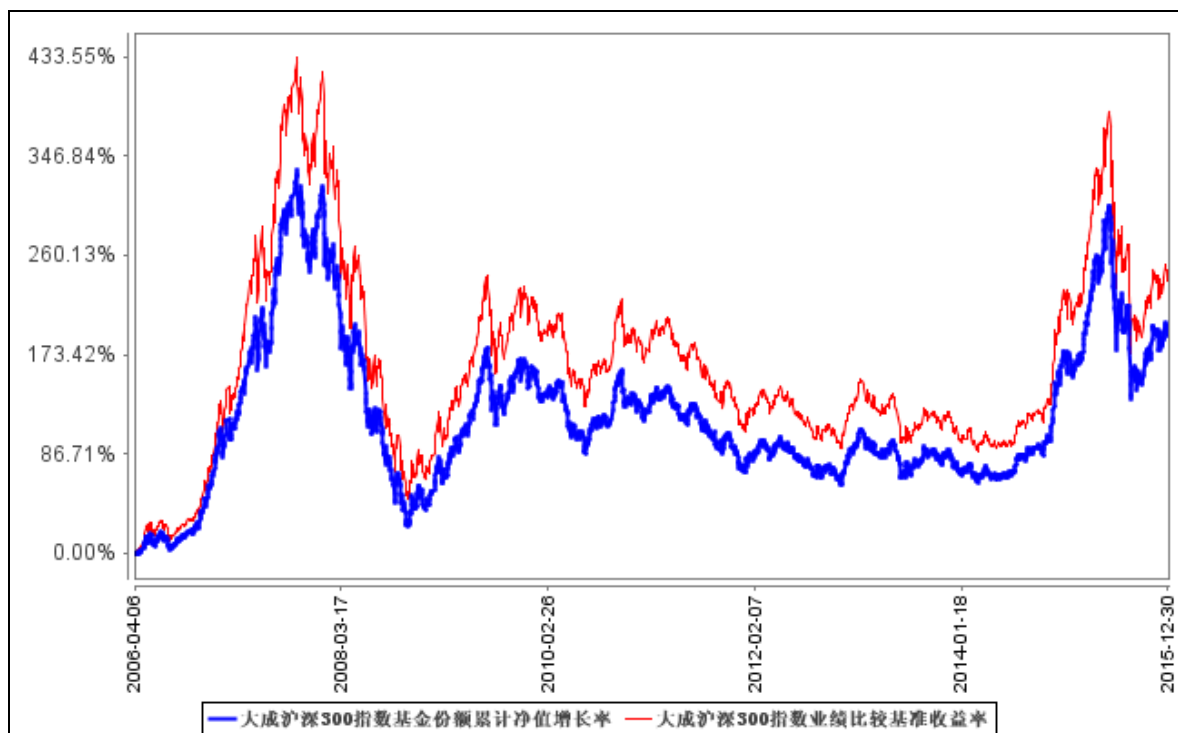
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

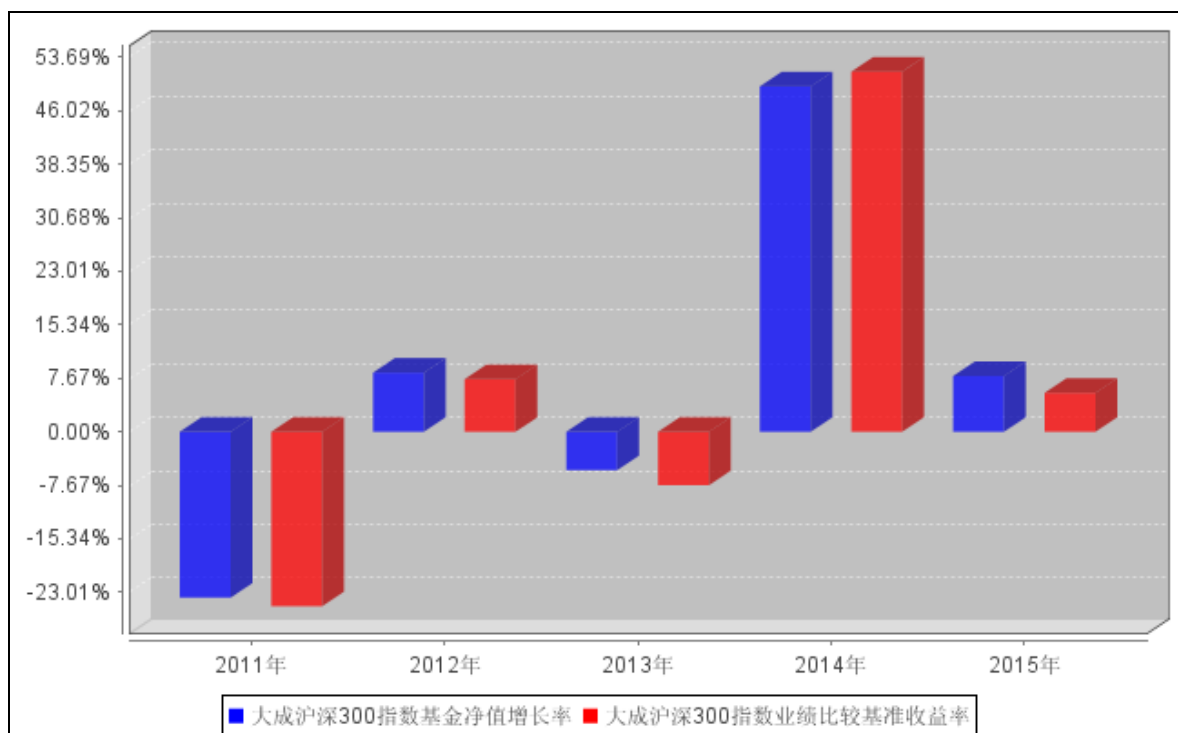
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	16.65%	1.64%	16.49%	1.67%	0.16%	-0.03%
过去六个月	-15.18%	2.65%	-16.59%	2.68%	1.41%	-0.03%
过去一年	7.99%	2.41%	5.58%	2.48%	2.41%	-0.07%
过去三年	52.55%	1.70%	47.88%	1.79%	4.67%	-0.09%
过去五年	26.16%	1.52%	19.27%	1.61%	6.89%	-0.09%
自基金合同生效起至今	190.08%	1.83%	238.19%	1.93%	-48.11%	-0.10%

#### 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。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2015年12月31日，本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金：大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及55只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹



稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	6 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013 年 3 月 25 日至 2015 年 1 月 14 日担任大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 和大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理助理。2015 年 2 月 28 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券

					<p>投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
苏秉毅先生	本基金基金经理 数量与指数投资部 副总监	2013 年 1 月 1 日	2015 年 8 月 25 日	12 年	<p>经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2014 年 1 月 23 日担任大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 17 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012 年 2 月 9 日至 2014 年 9 月 11 日担任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 3 月 5 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>

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。

3、本基金于 2016 年 3 月 5 日增聘苏秉毅先生为本基金基金经理，该事项已按法规要求及公司相

关制度办理，变更流程合法合规。

#### 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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 130 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指

数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年 A 股剧烈震荡，6 月中旬前在国内货币政策宽松，股市投资者不断加大杠杆的推动下，上证综指时隔七年后再次站上 5000 点。6 月 15 日之后两个多月，监管层控风险去杠杆，人民币意外大幅贬值，上证综指暴跌近 45%，半数以上上市公司股价腰斩。9 月后，小市值题材股大幅反弹，带动指数小幅上涨。纵观全年，成长股、题材股相对于大盘蓝筹股超额收益显著，创业板指数大幅上涨 84.4%，沪深 300 指数仅微涨 5.6%。

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

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.1925 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.99%，同期业绩比较基准收益率为 5.58%，高于业绩比较基准的表现。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基

金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、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

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管大成沪深 300 指数证券投资基金的过程中，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《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》的约定，对大成沪深 300 指数证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了

认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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大成沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成沪深 300 指数证券投资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 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的大成沪深 300 指数证券投资基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人大成基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控

	制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	昌 华	高 鹤
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 · 北京	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	143,804,326.92	178,450,236.82
结算备付金		517,433.75	1,641,327.32
存出保证金		1,087,128.59	410,639.92
交易性金融资产	7.4.7.2	2,157,251,819.17	5,808,430,342.55
其中：股票投资		2,107,191,819.17	5,608,231,342.55
基金投资		-	-
债券投资		50,060,000.00	200,199,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,670,875.40	7,619,391.10
应收股利		-	-



应收申购款		275,047.35	5,069,737.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,304,606,631.18	6,001,621,674.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,823,624.56	12,233,242.46
应付管理人报酬	7.4.10.2	1,473,090.50	3,429,439.13
应付托管费	7.4.10.2	294,618.09	685,887.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	875,270.48	1,974,849.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	242,504.59	453,447.48
负债合计		4,709,108.22	18,776,866.73
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,928,620,557.68	5,417,752,713.03
未分配利润	7.4.7.10	371,276,965.28	565,092,095.19
所有者权益合计		2,299,897,522.96	5,982,844,808.22
负债和所有者权益总计		2,304,606,631.18	6,001,621,674.95

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.1925 元，基金份额总额 1,928,620,557.68 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
<b>一、收入</b>		944,525,871.11	1,940,169,101.34
1. 利息收入		4,736,597.06	10,421,789.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,316,969.67	1,222,718.47

债券利息收入		3,419,627.39	9,037,997.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	161,073.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,246,616,865.06	-54,416,941.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,203,538,548.69	-150,680,724.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-657,580.00	1,057,560.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	43,735,896.37	95,206,222.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,312,244,354.36	1,982,892,161.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,416,763.35	1,272,091.66
<b>减：二、费用</b>		54,822,524.75	45,121,127.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,666,495.94	31,716,830.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,533,299.19	6,343,365.98
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	21,149,058.94	6,599,767.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	473,670.68	461,164.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		889,703,346.36	1,895,047,973.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		889,703,346.36	1,895,047,973.47

### 7.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,417,752,713.03	565,092,095.19	5,982,844,808.22

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	889,703,346.36	889,703,346.36
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）	-3,489,132,155.35	-1,083,518,476.27	-4,572,650,631.62
其中：1. 基金申购款	2,539,037,673.86	764,869,681.50	3,303,907,355.36
2. 基金赎回款	-6,028,169,829.21	-1,848,388,157.77	-7,876,557,986.98
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）	1,928,620,557.68	371,276,965.28	2,299,897,522.96
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	1,895,047,973.47	1,895,047,973.47
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）	-456,264,687.89	205,403,795.74	-250,860,892.15
其中：1. 基金申购款	2,270,237,628.21	-343,039,407.04	1,927,198,221.17
2. 基金赎回款	-2,726,502,316.10	548,443,202.78	-2,178,059,113.32
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）	5,417,752,713.03	565,092,095.19	5,982,844,808.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

基金管理人负责人

周立新

主管会计工作负责人

范瑛

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]24 号文《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人大成基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2006 年 4 月 6 日正式生效,首次设立募集规模为 1,813,356,066.47 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(简称“中国农业银行”)。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 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财产净值的 100%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券等投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

###### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

###### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配应当采用现金方式。基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择，基金管



理人应当支付现金；本基金默认的分红方式为现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金当期出现亏损，则可不进行收益分配；

(5) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年不超过 6 次，成立不满 3 个月，收益可不分配；

(7) 基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者实质性利益的情况下，基金管理人可酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，基金管理人应于实施更改前 2 日内在至少一种中国证监会指定报刊上刊登公告。

#### 7.4.4.12 其他重要会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

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

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需要说明的重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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

花税。

营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

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

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

个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	143,804,326.92	178,450,236.82
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-

合计：	143,804,326.92	178,450,236.82
-----	----------------	----------------

注：本基金于本期及上年度可比期间均未投资于定期存款或其他存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,041,901,230.17	2,107,191,819.17	65,290,589.00	
贵金属投资	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	49,946,150.00	50,060,000.00	113,850.00
	合计	49,946,150.00	50,060,000.00	113,850.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,091,847,380.17	2,157,251,819.17	65,404,439.00	
项目	上年度末 2014年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,230,118,969.19	5,608,231,342.55	1,378,112,373.36	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	200,662,580.00	200,199,000.00	-463,580.00
	合计	200,662,580.00	200,199,000.00	-463,580.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,430,781,549.19	5,808,430,342.55	1,377,648,793.36	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,673.95	37,054.00
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	232.80	738.60
应收债券利息	1,645,479.45	7,581,413.70
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	489.20	184.80
合计	1,670,875.40	7,619,391.10

## 7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	875,270.48	1,973,811.50
银行间市场应付交易费用	-	1,038.35
合计	875,270.48	1,974,849.85

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付赎回费	883.76	8,574.85
预提审计费	140,000.00	140,000.00
预提信息披露费	100,000.00	300,000.00
应付后端申购费	1,620.83	4,872.63
合计	242,504.59	453,447.48

## 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,417,752,713.03	5,417,752,713.03
本期申购	2,539,037,673.86	2,539,037,673.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-6,028,169,829.21	-6,028,169,829.21
本期末	1,928,620,557.68	1,928,620,557.68

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-202,255,740.12	767,347,835.31	565,092,095.19
本期利润	2,201,947,700.72	-1,312,244,354.36	889,703,346.36
本期基金份额交易产生的变动数	-754,562,007.74	-328,956,468.53	-1,083,518,476.27
其中：基金申购款	572,175,781.48	192,693,900.02	764,869,681.50
基金赎回款	-1,326,737,789.22	-521,650,368.55	-1,848,388,157.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,245,129,952.86	-873,852,987.58	371,276,965.28

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,146,900.49	1,062,750.17
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	64,210.35	20,044.30
其他	105,858.83	139,924.00
合计	1,316,969.67	1,222,718.47

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,541,481,051.33	2,223,914,606.69

减：卖出股票成本总额	6,337,942,502.64	2,374,595,330.83
买卖股票差价收入	2,203,538,548.69	-150,680,724.14

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	209,570,000.00	286,449,941.33
减：卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成本总额	200,662,580.00	278,178,000.00
减：应收利息总额	9,565,000.00	7,214,381.33
买卖债券差价收入	-657,580.00	1,057,560.00

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
股票投资产生的股利收益	43,735,896.37	95,206,222.39
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	43,735,896.37	95,206,222.39

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	-1,312,244,354.36	1,982,892,161.98
——股票投资	-1,312,821,784.36	1,983,194,111.98
——债券投资	577,430.00	-301,950.00

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,312,244,354.36	1,982,892,161.98

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	5,416,763.35	1,272,091.46
其他	-	0.20
合计	5,416,763.35	1,272,091.66

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。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	21,148,783.94	6,596,567.29
银行间市场交易费用	275.00	3,200.00
合计	21,149,058.94	6,599,767.29

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	140,000.00	140,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	50.00	379.00
银行划款手续费	15,620.68	7,285.19
债券帐户维护费	18,000.00	13,500.00
合计	473,670.68	461,164.19

#### 7.4.7.21 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2016 年 1 月 22 日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.963 元进行分红，其中现金形式发放总额人民币 96,633,463.94 元，再投资形式发放总额人民币 89,970,416.57 元，实际分配收益为人民币 186,603,880.51 元。

除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金并无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、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、基金销售机构
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（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

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

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

3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	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	4,019,449,476.17	32.13%	1,389,502,440.07	32.53%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.4 回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	3,639,303.25	32.13%	382,661.33	43.72%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	1,245,485.76	32.34%	703,388.22	35.64%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日

当期发生的基金应支付的管理费	27,666,495.94	31,716,830.41
其中：支付销售机构的客户维护费	6,242,662.08	7,634,602.61

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,533,299.19	6,343,365.98

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资于本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	143,804,326.92	1,146,900.49	178,450,236.82	1,062,750.17

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于报告期末进行利润分配。

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

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	14.69	-	-	417,059	3,880,162.35	6,126,596.71	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	71.46	-	-	122,875	4,386,883.65	8,780,647.50	-
600578	京能电力	2015年11月5日	重大事项	6.07	2016年2月24日	5.49	463,547	3,098,095.69	2,813,730.29	-
600649	城投控股	2015年12月30日	重大事项	23.16	2016年1月7日	20.84	281,413	2,065,312.96	6,517,525.08	-
600690	青岛海尔	2015年10月19日	重大事项	9.92	2016年2月1日	8.93	592,496	5,757,106.24	5,877,560.32	-
600783	鲁信创投	2015年12月31日	重大事项	39.07	2016年1月4日	37.60	90,034	2,866,107.89	3,517,628.38	-
600873	梅花生物	2015年12月17日	重大事项	9.14	-	-	508,312	4,468,595.84	4,645,971.68	-
601018	宁波港	2015年8月5日	重大事项	8.16	2016年2月22日	7.34	861,602	4,205,122.90	7,030,672.32	-
601377	兴业	2015年12月29日	重大	11.00	2016年1月7日	9.40	817,375	9,062,087.18	8,991,125.00	-

	证券	日	事项							
000002	万科 A	2015 年 12 月 21 日	重大 事项	24.43	-	-	1,386,185	16,089,580.65	33,864,499.55	-
000712	锦龙股份	2015 年 12 月 25 日	重大 事项	29.12	2016 年 1 月 4 日	28.00	138,500	5,432,850.65	4,033,120.00	-
000876	新希望	2015 年 8 月 17 日	重大 事项	18.99	2016 年 3 月 2 日	17.09	264,579	4,666,290.87	5,024,355.21	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大 事项	25.10	-	-	235,227	5,355,936.99	5,904,197.70	-
002465	海格通信	2015 年 12 月 30 日	重大 事项	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	437,304	5,045,383.84	7,298,603.76	-
300104	乐视网	2015 年 12 月 8 日	重大 事项	60.18	-	-	185,700	10,975,203.42	11,175,426.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到年本息，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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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 7.4.12.2 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	143,804,326.92	-	-	-	143,804,326.92
结算备付金	517,433.75	-	-	-	517,433.75
存出保证金	1,087,128.59	-	-	-	1,087,128.59
交易性金融资产	50,060,000.00	-	-	2,107,191,819.17	2,157,251,819.17
应收利息	-	-	-	1,670,875.40	1,670,875.40
应收申购款	7,118.69	-	-	267,928.66	275,047.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	195,476,007.95	-	-	2,109,130,623.23	2,304,606,631.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,823,624.56	1,823,624.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,473,090.50	1,473,090.50
应付托管费	-	-	-	294,618.09	294,618.09
应付交易费用	-	-	-	875,270.48	875,270.48
其他负债	-	-	-	242,504.59	242,504.59
负债总计	-	-	-	4,709,108.22	4,709,108.22
利率敏感度缺口	195,476,007.95	-	-	2,104,421,515.01	2,299,897,522.96
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	178,450,236.82	-	-	-	178,450,236.82
结算备付金	1,641,327.32	-	-	-	1,641,327.32
存出保证金	410,639.92	-	-	-	410,639.92
交易性金融资产	200,199,000.00	-	-	5,608,231,342.55	5,808,430,342.55
应收利息	-	-	-	7,619,391.10	7,619,391.10
应收申购款	150,563.74	-	-	4,919,173.50	5,069,737.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	380,851,767.80	-	-	5,620,769,907.15	6,001,621,674.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,233,242.46	12,233,242.46
应付管理人报酬	-	-	-	3,429,439.13	3,429,439.13
应付托管费	-	-	-	685,887.81	685,887.81
应付交易费用	-	-	-	1,974,849.85	1,974,849.85
其他负债	-	-	-	453,447.48	453,447.48
负债总计	-	-	-	18,776,866.73	18,776,866.73
利率敏感度缺口	380,851,767.80	-	-	5,601,993,040.42	5,982,844,808.22

## 7.4.13.4.1.2 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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基准点	-12,531.31	-106,763.70
	利率下降 25 个基准点	12,537.58	106,913.60

## 7.4.13.4.2 外汇风险

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

## 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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 2015 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	2,107,191,819.17	91.62	5,608,231,342.55	93.74
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	2,107,191,819.17	91.62	5,608,231,342.55	93.74

#### 7.4.13.4.3.2 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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
	沪深300指数上升5%	111,164,439.34	272,041,748.33
	沪深300指数下降5%	-111,164,439.34	-272,041,748.33

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币1,985,590,159.67元，划分为第二层次的余额为人民币171,661,659.50元，无划分为第三层次余额。（于2014年12月31日，本基金持有的持续以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币5,526,484,931.47元，划分为第二层次的余额为人民币281,945,411.08元，无划分为第三层次余额。）

###### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。



对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自2015年3月24日起，固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层级转入第二层级。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月25日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,107,191,819.17	91.43
	其中：股票	2,107,191,819.17	91.43
2	固定收益投资	50,060,000.00	2.17
	其中：债券	50,060,000.00	2.17
	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	144,321,760.67	6.26
7	其他各项资产	3,033,051.34	0.13
8	合计	2,304,606,631.18	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,173,938.48	0.09
B	采矿业	75,674,189.65	3.29
C	制造业	679,561,029.04	29.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,682,070.89	3.99
E	建筑业	80,035,344.09	3.48
F	批发和零售业	53,796,648.73	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	89,200,688.17	3.88
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,491,561.34	5.76
J	金融业	689,797,088.09	29.99
K	房地产业	106,237,716.10	4.62
L	租赁和商务服务业	27,072,662.42	1.18
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	23,180,858.87	1.01
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	3,751,325.04	0.16
R	文化、体育和娱乐业	40,154,103.16	1.75
S	综合	12,382,595.10	0.54
	合计	2,107,191,819.17	91.62

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,976,121	71,140,356.00	3.09
2	600036	招商银行	2,880,300	51,816,597.00	2.25
3	600016	民生银行	4,977,056	47,978,819.84	2.09

4	601166	兴业银行	2,571,486	43,895,266.02	1.91
5	600000	浦发银行	1,960,531	35,818,901.37	1.56
6	000002	万科A	1,386,185	33,864,499.55	1.47
7	600030	中信证券	1,585,009	30,669,924.15	1.33
8	601169	北京银行	2,862,914	30,146,484.42	1.31
9	601939	建设银行	4,757,740	27,499,737.20	1.20
10	601328	交通银行	4,067,111	26,192,194.84	1.14
11	601398	工商银行	5,132,918	23,508,764.44	1.02
12	601766	中国南车	1,782,052	22,899,368.20	1.00
13	600837	海通证券	1,430,693	22,633,563.26	0.98
14	601688	华泰证券	1,036,321	20,436,250.12	0.89
15	601668	中国建筑	3,051,167	19,344,398.78	0.84
16	600519	贵州茅台	86,375	18,846,161.25	0.82
17	000651	格力电器	832,090	18,597,211.50	0.81
18	600887	伊利股份	1,054,601	17,327,094.43	0.75
19	601988	中国银行	4,248,102	17,034,889.02	0.74
20	601601	中国太保	589,663	17,017,674.18	0.74
21	000001	平安银行	1,384,246	16,597,109.54	0.72
22	601989	中国重工	1,639,595	15,412,193.00	0.67
23	000333	美的集团	450,972	14,800,901.04	0.64
24	600637	东方明珠	369,573	14,003,120.97	0.61
25	600104	上汽集团	655,043	13,900,012.46	0.60
26	601009	南京银行	726,527	12,859,527.90	0.56
27	000858	五粮液	457,599	12,483,300.72	0.54
28	000725	京东方A	4,118,563	12,232,132.11	0.53
29	300059	东方财富	234,941	12,223,980.23	0.53
30	600015	华夏银行	998,787	12,125,274.18	0.53
31	600048	保利地产	1,110,487	11,815,581.68	0.51
32	002024	苏宁云商	873,325	11,746,221.25	0.51
33	600900	长江电力	859,012	11,648,202.72	0.51
34	000069	华侨城A	1,303,998	11,475,182.40	0.50
35	600999	招商证券	524,875	11,389,787.50	0.50
36	000783	长江证券	907,332	11,269,063.44	0.49
37	300104	乐视网	185,700	11,175,426.00	0.49
38	000776	广发证券	557,082	10,835,244.90	0.47
39	600518	康美药业	635,100	10,764,945.00	0.47
40	601006	大秦铁路	1,247,357	10,752,217.34	0.47
41	601390	中国中铁	979,485	10,695,976.20	0.47
42	600109	国金证券	662,080	10,672,729.60	0.46

43	600276	恒瑞医药	206,269	10,131,933.28	0.44
44	000063	中兴通讯	522,260	9,729,703.80	0.42
45	601628	中国人寿	337,938	9,567,024.78	0.42
46	000166	申万宏源	892,398	9,557,582.58	0.42
47	601618	中国中冶	1,576,738	9,491,962.76	0.41
48	600050	中国联通	1,530,436	9,458,094.48	0.41
49	600028	中国石化	1,889,169	9,370,278.24	0.41
50	300027	华谊兄弟	225,393	9,349,301.64	0.41
51	000046	泛海控股	720,970	9,048,173.50	0.39
52	601998	中信银行	1,245,327	8,991,260.94	0.39
53	601377	兴业证券	817,375	8,991,125.00	0.39
54	600271	航天信息	122,875	8,780,647.50	0.38
55	600383	金地集团	622,525	8,590,845.00	0.37
56	600011	华能国际	959,372	8,375,317.56	0.36
57	601186	中国铁建	617,215	8,320,058.20	0.36
58	600795	国电电力	2,115,605	8,314,327.65	0.36
59	002202	金风科技	364,365	8,303,878.35	0.36
60	002450	康得新	214,580	8,175,498.00	0.36
61	601899	紫金矿业	2,281,299	8,030,172.48	0.35
62	601985	中国核电	826,510	7,884,905.40	0.34
63	300070	碧水源	152,293	7,884,208.61	0.34
64	000415	渤海租赁	860,596	7,762,575.92	0.34
65	601901	方正证券	808,315	7,759,824.00	0.34
66	600060	海信电器	386,126	7,595,098.42	0.33
67	002415	海康威视	220,730	7,590,904.70	0.33
68	002304	洋河股份	108,722	7,451,805.88	0.32
69	002673	西部证券	226,054	7,439,437.14	0.32
70	000917	电广传媒	278,414	7,394,675.84	0.32
71	601919	中国远洋	819,700	7,393,694.00	0.32
72	601099	太平洋	751,160	7,376,391.20	0.32
73	600705	中航资本	473,409	7,375,712.22	0.32
74	600839	四川长虹	1,269,942	7,352,964.18	0.32
75	600066	宇通客车	326,061	7,333,111.89	0.32
76	601555	东吴证券	454,898	7,310,210.86	0.32
77	002465	海格通信	437,304	7,298,603.76	0.32
78	600029	南方航空	848,426	7,271,010.82	0.32
79	601866	中海集运	1,029,094	7,244,821.76	0.32
80	600485	信威集团	270,757	7,242,749.75	0.31
81	002594	比亚迪	111,041	7,151,040.40	0.31

82	600585	海螺水泥	417,168	7,133,572.80	0.31
83	601857	中国石油	848,056	7,081,267.60	0.31
84	000895	双汇发展	346,203	7,066,003.23	0.31
85	601018	宁波港	861,602	7,030,672.32	0.31
86	300124	汇川技术	146,500	6,914,800.00	0.30
87	600009	上海机场	233,281	6,886,455.12	0.30
88	600893	中航动力	151,509	6,822,450.27	0.30
89	000625	长安汽车	402,000	6,821,940.00	0.30
90	000423	东阿阿胶	129,883	6,792,880.90	0.30
91	000538	云南白药	93,426	6,784,596.12	0.29
92	600089	特变电工	574,061	6,756,697.97	0.29
93	000100	TCL 集团	1,584,826	6,751,358.76	0.29
94	000413	东旭光电	737,700	6,698,316.00	0.29
95	600804	鹏博士	281,282	6,672,009.04	0.29
96	601211	国泰君安	278,132	6,647,354.80	0.29
97	600642	申能股份	875,674	6,611,338.70	0.29
98	600649	城投控股	281,413	6,517,525.08	0.28
99	000503	海虹控股	189,437	6,344,245.13	0.28
100	600406	国电南瑞	379,842	6,335,764.56	0.28
101	300024	机器人	92,011	6,302,753.50	0.27
102	600369	西南证券	636,592	6,302,260.80	0.27
103	600010	包钢股份	1,714,826	6,190,521.86	0.27
104	000157	中联重科	1,156,757	6,188,649.95	0.27
105	600115	东方航空	812,220	6,180,994.20	0.27
106	300058	蓝色光标	418,268	6,161,087.64	0.27
107	601607	上海医药	309,241	6,156,988.31	0.27
108	600019	宝钢股份	1,102,430	6,151,559.40	0.27
109	600153	建发股份	417,059	6,126,596.71	0.27
110	600340	华夏幸福	199,251	6,120,990.72	0.27
111	002230	科大讯飞	164,616	6,099,022.80	0.27
112	601727	上海电气	526,200	6,072,348.00	0.26
113	000728	国元证券	268,315	6,061,235.85	0.26
114	601336	新华保险	115,270	6,018,246.70	0.26
115	002241	歌尔声学	173,826	6,014,379.60	0.26
116	001979	招商蛇口	288,094	6,009,640.84	0.26
117	600100	同方股份	331,001	5,984,498.08	0.26
118	002065	东华软件	235,227	5,904,197.70	0.26
119	600415	小商品城	642,261	5,902,378.59	0.26
120	601669	中国电建	734,856	5,900,893.68	0.26

121	600221	海南航空	1, 516, 721	5, 900, 044. 69	0. 26
122	600690	青岛海尔	592, 496	5, 877, 560. 32	0. 26
123	000338	潍柴动力	595, 166	5, 749, 303. 56	0. 25
124	002736	国信证券	290, 100	5, 729, 475. 00	0. 25
125	002470	金正大	281, 266	5, 720, 950. 44	0. 25
126	000768	中航飞机	229, 349	5, 680, 974. 73	0. 25
127	600688	上海石化	874, 853	5, 669, 047. 44	0. 25
128	601600	中国铝业	1, 139, 243	5, 662, 037. 71	0. 25
129	601106	中国一重	707, 800	5, 641, 166. 00	0. 25
130	600958	东方证券	241, 600	5, 626, 864. 00	0. 24
131	600703	三安光电	231, 411	5, 618, 659. 08	0. 24
132	601933	永辉超市	554, 567	5, 601, 126. 70	0. 24
133	600256	广汇能源	838, 855	5, 595, 162. 85	0. 24
134	600111	北方稀土	396, 454	5, 558, 285. 08	0. 24
135	300017	网宿科技	92, 405	5, 543, 375. 95	0. 24
136	600177	雅戈尔	339, 005	5, 519, 001. 40	0. 24
137	600085	同仁堂	122, 387	5, 459, 684. 07	0. 24
138	600570	恒生电子	89, 286	5, 443, 767. 42	0. 24
139	002142	宁波银行	346, 143	5, 368, 677. 93	0. 23
140	601088	中国神华	357, 565	5, 352, 748. 05	0. 23
141	000999	华润三九	193, 189	5, 274, 059. 70	0. 23
142	002475	立讯精密	164, 557	5, 257, 596. 15	0. 23
143	002153	石基信息	34, 720	5, 242, 720. 00	0. 23
144	600315	上海家化	131, 304	5, 185, 194. 96	0. 23
145	002500	山西证券	339, 378	5, 172, 120. 72	0. 22
146	600118	中国卫星	119, 878	5, 099, 610. 12	0. 22
147	600208	新潮中宝	1, 059, 945	5, 055, 937. 65	0. 22
148	000686	东北证券	287, 889	5, 038, 057. 50	0. 22
149	000876	新希望	264, 579	5, 024, 355. 21	0. 22
150	600027	华电国际	737, 176	5, 012, 796. 80	0. 22
151	600583	海油工程	558, 686	5, 000, 239. 70	0. 22
152	600886	国投电力	598, 790	4, 999, 896. 50	0. 22
153	600352	浙江龙盛	428, 974	4, 993, 257. 36	0. 22
154	002292	奥飞动漫	96, 388	4, 984, 223. 48	0. 22
155	600588	用友网络	156, 593	4, 981, 223. 33	0. 22
156	000156	华数传媒	151, 832	4, 980, 089. 60	0. 22
157	300003	乐普医疗	128, 738	4, 969, 286. 80	0. 22
158	000559	万向钱潮	218, 676	4, 948, 637. 88	0. 22
159	600535	天士力	120, 336	4, 924, 149. 12	0. 21

160	600150	中国船舶	140,761	4,902,705.63	0.21
161	601333	广深铁路	975,241	4,885,957.41	0.21
162	000009	中国宝安	270,307	4,854,713.72	0.21
163	600998	九州通	246,925	4,839,730.00	0.21
164	002236	大华股份	130,647	4,820,874.30	0.21
165	000750	国海证券	370,279	4,758,085.15	0.21
166	002129	中环股份	388,587	4,748,533.14	0.21
167	600031	三一重工	720,704	4,742,232.32	0.21
168	600038	中直股份	89,775	4,733,835.75	0.21
169	300002	神州泰岳	356,658	4,672,219.80	0.20
170	601021	春秋航空	76,322	4,655,642.00	0.20
171	600873	梅花生物	508,312	4,645,971.68	0.20
172	601117	中国化学	671,299	4,625,250.11	0.20
173	600739	辽宁成大	203,978	4,609,902.80	0.20
174	601991	大唐发电	884,218	4,544,880.52	0.20
175	002422	科伦药业	242,162	4,504,213.20	0.20
176	600718	东软集团	144,987	4,501,846.35	0.20
177	600196	复星医药	191,201	4,491,311.49	0.20
178	600674	川投能源	414,520	4,460,235.20	0.19
179	000800	一汽轿车	271,523	4,444,831.51	0.19
180	601872	招商轮船	625,196	4,432,639.64	0.19
181	600170	上海建工	624,867	4,424,058.36	0.19
182	002385	大北农	360,886	4,406,418.06	0.19
183	600489	中金黄金	440,247	4,371,652.71	0.19
184	002353	杰瑞股份	169,303	4,296,910.14	0.19
185	600827	百联股份	240,312	4,294,375.44	0.19
186	600068	葛洲坝	545,475	4,292,888.25	0.19
187	601238	广汽集团	190,200	4,292,814.00	0.19
188	601258	庞大集团	1,094,758	4,291,451.36	0.19
189	600875	东方电气	314,712	4,289,524.56	0.19
190	002252	上海莱士	106,288	4,227,073.76	0.18
191	002456	欧菲光	136,163	4,223,776.26	0.18
192	600373	中文传媒	179,504	4,216,548.96	0.18
193	300133	华策影视	139,825	4,165,386.75	0.18
194	601888	中国国旅	70,108	4,158,105.48	0.18
195	000629	攀钢钒钛	1,128,249	4,140,673.83	0.18
196	601111	中国国航	481,399	4,130,403.42	0.18
197	000729	燕京啤酒	501,149	4,124,456.27	0.18
198	000883	湖北能源	670,900	4,119,326.00	0.18

199	600867	通化东宝	151,265	4,109,870.05	0.18
200	600018	上港集团	631,757	4,093,785.36	0.18
201	600157	永泰能源	846,009	4,035,462.93	0.18
202	000712	锦龙股份	138,500	4,033,120.00	0.18
203	600863	内蒙华电	900,272	4,024,215.84	0.17
204	000623	吉林敖东	129,768	4,016,319.60	0.17
205	600895	张江高科	139,100	4,010,253.00	0.17
206	600663	陆家嘴	79,444	3,983,322.16	0.17
207	600660	福耀玻璃	261,316	3,969,390.04	0.17
208	000709	河北钢铁	1,188,941	3,959,173.53	0.17
209	002008	大族激光	152,256	3,941,907.84	0.17
210	600166	福田汽车	619,611	3,922,137.63	0.17
211	002038	双鹭药业	116,721	3,910,153.50	0.17
212	300144	宋城演艺	137,391	3,888,165.30	0.17
213	300315	掌趣科技	275,600	3,858,400.00	0.17
214	600023	浙能电力	514,557	3,854,031.93	0.17
215	000826	启迪桑德	96,453	3,821,467.86	0.17
216	000568	泸州老窖	139,802	3,791,430.24	0.16
217	601179	中国西电	553,222	3,767,441.82	0.16
218	300015	爱尔眼科	118,788	3,751,325.04	0.16
219	002410	广联达	205,972	3,744,570.96	0.16
220	600252	中恒集团	507,361	3,724,029.74	0.16
221	600317	营口港	782,557	3,717,145.75	0.16
222	601800	中国交建	276,168	3,703,412.88	0.16
223	000738	中航动控	116,825	3,694,006.50	0.16
224	002195	二三四五	99,360	3,676,320.00	0.16
225	000792	盐湖股份	140,587	3,610,274.16	0.16
226	000425	徐工机械	844,646	3,589,745.50	0.16
227	600398	海澜之家	255,287	3,563,806.52	0.15
228	000402	金融街	306,297	3,531,604.41	0.15
229	601718	际华集团	307,700	3,529,319.00	0.15
230	600783	鲁信创投	90,034	3,517,628.38	0.15
231	600309	万华化学	196,512	3,507,739.20	0.15
232	000963	华东医药	42,764	3,504,937.44	0.15
233	600372	中航电子	137,742	3,392,585.46	0.15
234	000060	中金岭南	240,633	3,376,080.99	0.15
235	002081	金螳螂	180,268	3,367,406.24	0.15
236	601098	中南传媒	140,291	3,352,954.90	0.15
237	600820	隧道股份	312,800	3,328,192.00	0.14



238	600741	华域汽车	193,940	3,269,828.40	0.14
239	000540	中天城投	357,193	3,257,600.16	0.14
240	600332	白云山	106,043	3,209,921.61	0.14
241	000039	中集集团	152,242	3,197,082.00	0.14
242	601633	长城汽车	263,037	3,166,965.48	0.14
243	601198	东兴证券	104,600	3,134,862.00	0.14
244	000061	农产品	174,591	3,088,514.79	0.13
245	002739	万达院线	25,600	3,072,000.00	0.13
246	000778	新兴铸管	465,785	3,022,944.65	0.13
247	000539	粤电力A	403,200	2,963,520.00	0.13
248	002146	荣盛发展	306,715	2,922,993.95	0.13
249	600578	京能电力	463,547	2,813,730.29	0.12
250	000831	五矿稀土	135,685	2,808,679.50	0.12
251	600547	山东黄金	133,550	2,804,550.00	0.12
252	601231	环旭电子	192,420	2,782,393.20	0.12
253	000581	威孚高科	110,668	2,740,139.68	0.12
254	000630	铜陵有色	749,935	2,684,767.30	0.12
255	601225	陕西煤业	552,000	2,682,720.00	0.12
256	002007	华兰生物	60,511	2,662,484.00	0.12
257	603000	人民网	116,614	2,659,965.34	0.12
258	300146	汤臣倍健	68,704	2,645,104.00	0.12
259	300251	光线传媒	87,035	2,636,290.15	0.11
260	000983	西山煤电	433,575	2,636,136.00	0.11
261	600648	外高桥	99,936	2,625,318.72	0.11
262	600005	武钢股份	756,310	2,624,395.70	0.11
263	601928	凤凰传媒	164,561	2,621,456.73	0.11
264	000598	兴蓉环境	366,152	2,607,002.24	0.11
265	600362	江西铜业	165,044	2,597,792.56	0.11
266	600959	江苏有线	124,349	2,556,615.44	0.11
267	002375	亚厦股份	161,119	2,540,846.63	0.11
268	600021	上海电力	170,300	2,506,816.00	0.11
269	601216	内蒙君正	218,616	2,503,153.20	0.11
270	601958	金钼股份	298,995	2,475,678.60	0.11
271	000027	深圳能源	251,460	2,466,822.60	0.11
272	603993	洛阳钼业	521,944	2,327,870.24	0.10
273	000400	许继电气	116,169	2,257,163.67	0.10
274	601898	中煤能源	369,309	2,234,319.45	0.10
275	601699	潞安环能	347,327	2,229,839.34	0.10
276	601992	金隅股份	236,695	2,217,832.15	0.10

277	600600	青岛啤酒	66,396	2,204,347.20	0.10
278	603288	海天味业	61,718	2,181,731.30	0.09
279	601118	海南橡胶	287,558	2,173,938.48	0.09
280	002294	信立泰	71,019	2,139,092.28	0.09
281	600008	首创股份	206,735	2,106,629.65	0.09
282	000825	太钢不锈	481,700	1,974,970.00	0.09
283	601808	中海油服	125,560	1,948,691.20	0.08
284	000937	冀中能源	385,547	1,943,156.88	0.08
285	000898	鞍钢股份	405,954	1,936,400.58	0.08
286	600633	浙报传媒	99,411	1,871,909.13	0.08
287	600717	天津港	165,642	1,866,785.34	0.08
288	002399	海普瑞	51,915	1,836,233.55	0.08
289	600549	厦门钨业	95,502	1,796,392.62	0.08
290	601608	中信重工	245,795	1,683,695.75	0.07
291	600350	山东高速	206,300	1,466,793.00	0.06
292	601158	重庆水务	148,613	1,386,559.29	0.06
293	603885	吉祥航空	37,800	1,291,626.00	0.06
294	601016	节能风电	62,200	981,516.00	0.04
295	600188	兖州煤业	99,039	935,918.55	0.04
296	601969	海南矿业	33,900	477,651.00	0.02

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	93,693,546.15	1.57
2	600016	民生银行	88,573,511.02	1.48
3	600036	招商银行	75,812,758.97	1.27
4	601398	工商银行	66,948,938.80	1.12
5	601766	中国中车	64,342,719.48	1.08
6	600000	浦发银行	59,852,920.64	1.00
7	601988	中国银行	49,610,540.53	0.83
8	600030	中信证券	49,106,876.46	0.82
9	601166	兴业银行	48,655,608.44	0.81
10	601328	交通银行	39,103,940.00	0.65

11	600837	海通证券	38,210,377.80	0.64
12	000166	申万宏源	37,186,555.73	0.62
13	600887	伊利股份	36,759,410.61	0.61
14	601939	建设银行	35,864,184.00	0.60
15	601601	中国太保	33,705,439.63	0.56
16	000002	万科A	30,348,288.19	0.51
17	601688	华泰证券	30,200,611.55	0.50
18	000001	平安银行	30,148,280.03	0.50
19	000776	广发证券	29,150,363.83	0.49
20	601169	北京银行	29,089,529.62	0.49

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	245,269,251.41	4.10
2	601318	中国平安	238,114,489.44	3.98
3	600016	民生银行	193,826,488.55	3.24
4	600030	中信证券	149,509,408.39	2.50
5	600000	浦发银行	145,595,292.65	2.43
6	601166	兴业银行	133,174,477.37	2.23
7	600837	海通证券	118,319,325.57	1.98
8	601398	工商银行	104,812,799.46	1.75
9	601939	建设银行	100,462,243.29	1.68
10	000002	万科A	95,022,421.91	1.59
11	601328	交通银行	88,694,838.48	1.48
12	600887	伊利股份	81,084,816.87	1.36
13	601601	中国太保	80,131,923.65	1.34
14	600015	华夏银行	73,449,697.67	1.23
15	000651	格力电器	72,402,699.74	1.21
16	600519	贵州茅台	72,077,771.39	1.20
17	601668	中国建筑	70,952,581.57	1.19
18	601766	中国中车	70,875,664.97	1.18
19	601988	中国银行	70,870,960.69	1.18
20	000001	平安银行	70,010,526.45	1.17

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,149,724,763.62
卖出股票收入（成交）总额	8,541,481,051.33

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	50,060,000.00	2.18
	其中：政策性金融债	50,060,000.00	2.18
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	-	0.00
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	50,060,000.00	2.18

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	150202	15 国开 02	500,000	50,060,000.00	2.18

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券之一中信证券，2015 年 1 月 16 日因“违规为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月”。2015 年 11 月 26 日因“公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定”被中国证监会立案调查。本基金认为，对中信证券的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,087,128.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,670,875.40
5	应收申购款	275,047.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,033,051.34

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	33,864,499.55	1.47	重大事项

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
134,635	14,324.81	7,603,167.44	0.39%	1,921,017,390.24	99.61%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

#### 9.2 期末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	657,619.16	0.0340%

#### 9.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	5,417,752,713.03
本报告期基金总申购份额	2,539,037,673.86
减：本报告期基金总赎回份额	6,028,169,829.21
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	1,928,620,557.68

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## 一、基金管理人的重大人事变动

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

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

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

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

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动  
无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 14 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	4,019,449,476.17	32.13%	3,639,303.25	32.13%	-
招商证券	2	1,965,190,712.61	15.71%	1,744,753.51	15.40%	-
齐鲁证券	1	1,642,477,956.45	13.13%	1,501,032.87	13.25%	-
安信证券	1	975,138,002.46	7.79%	887,763.07	7.84%	-
中信证券	2	733,057,033.42	5.86%	668,794.95	5.90%	-
申银万国	1	529,230,355.79	4.23%	486,119.40	4.29%	-
兴业证券	2	518,387,121.31	4.14%	467,056.76	4.12%	-



银河证券	4	494,660,067.26	3.95%	450,425.51	3.98%	-
国信证券	1	479,270,839.92	3.83%	436,328.98	3.85%	-
方正证券	1	429,704,021.45	3.43%	391,202.64	3.45%	-
海通证券	1	200,995,775.12	1.61%	177,862.37	1.57%	-
中金公司	2	179,370,099.97	1.43%	158,726.04	1.40%	-
上海证券	1	142,967,106.60	1.14%	133,145.88	1.18%	-
长城证券	2	67,174,999.10	0.54%	62,560.03	0.55%	-
联讯证券	1	43,605,174.78	0.35%	39,737.83	0.35%	-
华泰证券	1	36,923,078.97	0.30%	32,673.81	0.29%	-
中信建投	2	33,599,185.76	0.27%	30,620.32	0.27%	-
国泰君安	2	20,594,870.06	0.16%	18,224.81	0.16%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	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%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字

[2007]48 号) 的有关规定, 本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

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

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

本报告期内本基金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: 第一创业、山西证券、联讯证券、华西证券、川财证券。本报告期内退租交易单元: 中信建投。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
1	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书(2015 年 2 期) -摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/20
2	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书(2015 年 2 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/20
3	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/24
4	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
5	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
6	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年半年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
7	大成沪深 300 指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/26
8	关于大成沪深 300 指数证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29

9	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/21
10	大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书摘要 (2015 第 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/21
11	大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书 (2015 第 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/21
12	大成沪深 300 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
13	大成沪深 300 指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
14	大成沪深 300 指数证券投资基金 2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
15	关于大成沪深 300 指数证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/17
16	大成沪深 300 指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21
17	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
18	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/18
19	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/28
20	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29
21	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/4
22	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/11
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分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	2015/8/12
24	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/26
25	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/13
26	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/17
27	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
28	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/5
29	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/20
30	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/3

31	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“鹏博士”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/3
32	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
33	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华域汽车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/18
34	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“海虹控股”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/24
35	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“广联达”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/25
36	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“航天信息”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/26
37	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“桑德环境”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/3
38	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商银行”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/8
39	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/10
40	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/16
41	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“汇川技术”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/22
42	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“奥飞动漫”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/21
43	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“网宿科技”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/21
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国南车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/22
45	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金螳螂”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/23
46	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“铜陵有色”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/28

	告		
47	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三安光电”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/29
48	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国国旅”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/3
49	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“城投控股”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/18
50	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“亚厦股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/20
51	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华东医药”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/27
52	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“盘江股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/4
53	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“欧菲光”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/4
54	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“海虹控股”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
55	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长江电力”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
56	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“国投电力”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/8
57	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华谊兄弟”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
58	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“建发股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
59	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金螳螂”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
60	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“九州通”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
61	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“上海家化”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9

62	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长城汽车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
63	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“爱尔眼科”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
64	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“航天信息”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
65	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“康得新”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
66	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
67	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科伦药业”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
68	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三安光电”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
69	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“网宿科技”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
70	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“桑德环境”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/14
71	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/7
72	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
73	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
74	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
75	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
76	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
77	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
78	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

79	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
80	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
81	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
82	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
83	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
84	“大成上上签”活动获奖名单	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
85	大成基金电子直销交易系统维护通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
86	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/12
87	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
88	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
89	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
90	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融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	2015/3/31
91	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
92	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
93	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/17
94	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
95	大成基金管理有限公司关于增加联讯证券股份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	2015/5/5
96	关于大成基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/7

97	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
98	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	2015/5/9
99	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	2015/5/9
100	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	2015/5/12
101	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
102	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
103	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的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/19
104	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/2
105	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/3
106	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建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	2015/6/8
107	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/11
108	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
109	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/27
110	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
111	大成基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
112	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
113	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/27
114	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29
115	关于大成基金管理有限公司上海理财	中国证监会指定报刊及本公	2015/8/13



	中心办公地址变更的公告	司网站	
116	大成基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2015/8/14
117	大成基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/22
118	大成基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/1
119	大成基金管理有限公司关于增加南京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	2015/9/12
120	大成基金管理有限公司关于增加南京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	2015/9/15
121	大成基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/17
122	大成基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
123	大成基金管理有限公司关于参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
124	大成基金管理有限公司关于增加上海银行股份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	2015/9/30
125	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	2015/10/15
126	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/15
127	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	2015/10/16
128	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
129	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
130	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	2015/10/30
131	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/10
132	关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/16

133	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/28
134	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/2
135	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/17
136	大成基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份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	2015/12/18
137	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
138	大成基金管理有限公司关于网上直销系统暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
139	大成基金管理有限公司关于指数熔断机制对公司旗下公募基金相关业务事项影响的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/31

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 13 备查文件目录

#### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复；
- 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

#### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

#### 13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日