

大成沪深 300 指数证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§ 5 托管人报告	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）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43

§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
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	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 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	2,063,459,749.17 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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031

法定代表人	刘卓	周慕冰
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-108,720,613.95
本期利润	-338,770,705.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1658
本期加权平均净值利润率	-18.04%
本期基金份额净值增长率	-14.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-167,839,011.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0813
期末基金资产净值	1,895,620,737.65
期末基金份额净值	0.9187
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	147.53%

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）。

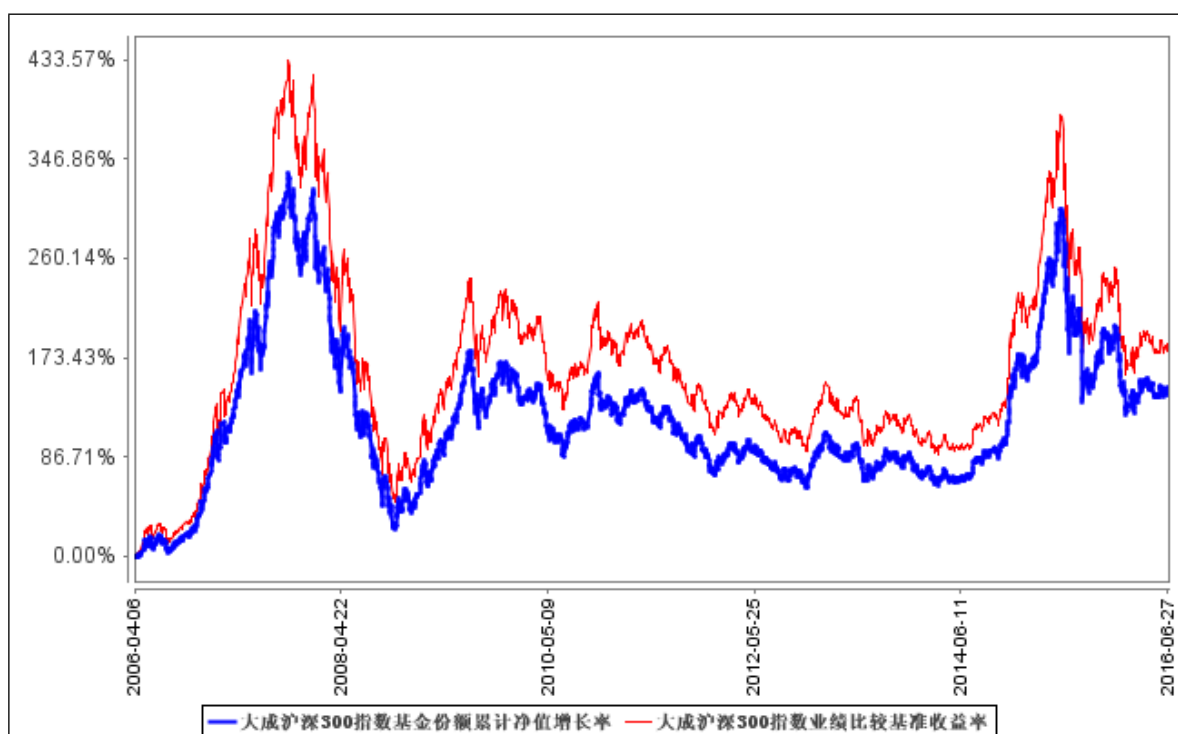
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.26%	0.93%	-0.49%	0.98%	0.75%	-0.05%
过去三个月	-1.32%	0.99%	-1.99%	1.01%	0.67%	-0.02%
过去六个月	-14.67%	1.80%	-15.47%	1.84%	0.80%	-0.04%
过去一年	-27.62%	2.27%	-29.49%	2.30%	1.87%	-0.03%
过去三年	46.25%	1.76%	43.32%	1.84%	2.93%	-0.08%
自基金合同生效起至今	147.53%	1.83%	185.88%	1.93%	-38.35%	-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：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六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，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）、大成月添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、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015 年 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
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资	2016 年 3 月 4 日	-	12 年	经济学硕士。2004 年 9 月至 2008 年 5 月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008 年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高

	部副总监			<p>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 4 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成沪深 300 指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕

交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，随着政策的摇摆，宏观经济也在不断反复。年初，在供给侧改革、去库存、投资需求拉动等措施的共振下，宏观经济有了起色。新增信贷放出巨量，PMI 等经济数据都得到了明显改善。在需求回暖和资金炒作叠加作用下，以黑色系为代表的大宗商品价格一度大幅反弹。后来，在权威人士表态定调经济“L”型后，情况发生了变化，政策刺激力度明显减弱，经济重新回到筑底的轨道上。人民币汇率在保持稳定一段时间后汇率继续贬值，但对出口的提振仍然有限。

国内环境起伏不定，国际环境同样充满变数。欧洲恶性事件层出不穷，英国公投脱欧，各经

济体“负利率”愈演愈烈却收效甚微。若应对失当，爆发全球范围的政治、经济危机并非毫无可能。

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

上半年，本基金申购赎回和份额交易情况均较为平稳。本基金基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。上半年年化跟踪误差 1.51%，日均偏离度 0.0071%，各项操作与指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.9187 元。本报告期内基金份额净值增长率为-14.67%，同期业绩比较基准收益率-15.47%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成沪深 300 指数证券投资基金已分配利润 186,603,880.51 元（每十份基金份额分红 0.963 元），符合基金合同规定的分红比例。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	166,551,278.10	143,804,326.92
结算备付金		1,122,545.12	517,433.75
存出保证金		183,772.09	1,087,128.59
交易性金融资产	6.4.3.2	1,730,968,874.28	2,157,251,819.17
其中：股票投资		1,730,968,874.28	2,107,191,819.17
基金投资		-	-
债券投资		-	50,060,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	28,815.80	1,670,875.40
应收股利		-	-
应收申购款		130,258.94	275,047.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,898,985,544.33	2,304,606,631.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,600.75	-
应付赎回款		937,940.94	1,823,624.56
应付管理人报酬		1,155,637.08	1,473,090.50
应付托管费		231,127.43	294,618.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	802,187.11	875,270.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	221,313.37	242,504.59
负债合计		3,364,806.68	4,709,108.22
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	2,063,459,749.17	1,928,620,557.68
未分配利润	6.4.3.10	-167,839,011.52	371,276,965.28
所有者权益合计		1,895,620,737.65	2,299,897,522.96
负债和所有者权益总计		1,898,985,544.33	2,304,606,631.18

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9187 元，基金份额总额 2,063,459,749.17 份。

6.2 利润表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 30 日
一、收入		-328,095,808.69	1,438,540,733.07
1. 利息收入		783,860.22	3,366,028.60
其中：存款利息收入	6.4.3.11	609,339.67	863,880.66
债券利息收入		174,520.55	2,502,147.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-98,888,053.57	2,193,473,852.27
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-115,791,636.97	2,170,995,978.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	53,850.00	-657,580.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	16,849,733.40	23,135,453.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-230,050,092.01	-763,287,540.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	58,476.67	4,988,392.81
减：二、费用		10,674,897.27	40,397,297.74
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	7,003,281.97	18,605,374.45
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,400,656.42	3,721,074.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	2,040,744.19	17,827,616.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	230,214.69	243,231.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-338,770,705.96	1,398,143,435.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-338,770,705.96	1,398,143,435.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,928,620,557.68	371,276,965.28	2,299,897,522.96
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-338,770,705.96	-338,770,705.96
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)	134,839,191.49	-13,741,390.33	121,097,801.16
其中: 1. 基金申购款	237,075,126.47	-21,008,199.74	216,066,926.73
2. 基金赎回款	-102,235,934.98	7,266,809.41	-94,969,125.57
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)	-	-186,603,880.51	-186,603,880.51
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,063,459,749.17	-167,839,011.52	1,895,620,737.65
	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
项目	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)	-	1,398,143,435.33	1,398,143,435.33
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)	-3,093,347,036.91	-1,019,571,972.54	-4,112,919,009.45
其中: 1. 基金申购款	2,350,242,420.78	729,389,409.81	3,079,631,830.59
2. 基金赎回款	-5,443,589,457.69	-1,748,961,382.35	-7,192,550,840.04
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,324,405,676.12	943,663,557.98	3,268,069,234.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗登攀	_____ 周立新	_____ 范瑛
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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

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

个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	166,551,278.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	166,551,278.10

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,895,614,527.29	1,730,968,874.28	-164,645,653.01
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	1,895,614,527.29	1,730,968,874.28	-164,645,653.01

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产**6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	28,286.78
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	454.59
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	74.43
合计	28,815.80

6.4.3.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	802,187.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	802,187.11

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	2,518.43
预提费用	218,794.94
合计	221,313.37

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,928,620,557.68	1,928,620,557.68
本期申购	237,075,126.47	237,075,126.47
本期赎回（以“-”号填列）	-102,235,934.98	-102,235,934.98
本期末	2,063,459,749.17	2,063,459,749.17

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,245,129,952.86	-873,852,987.58	371,276,965.28
本期利润	-108,720,613.95	-230,050,092.01	-338,770,705.96
本期基金份额交易产生的变动数	73,182,684.18	-86,924,074.51	-13,741,390.33
其中：基金申购款	128,561,422.94	-149,569,622.68	-21,008,199.74
基金赎回款	-55,378,738.76	62,645,548.17	7,266,809.41
本期已分配利润	-186,603,880.51	-	-186,603,880.51
本期末	1,022,988,142.58	-1,190,827,154.10	-167,839,011.52

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	8,702.63
其他	3,004.76
合计	609,339.67

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	690,239,907.98
减：卖出股票成本总额	806,031,544.95
买卖股票差价收入	-115,791,636.97

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,820,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	49,946,150.00
减：应收利息总额	1,820,000.00
买卖债券差价收入	53,850.00

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	16,849,733.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,849,733.40

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-230,050,092.01
——股票投资	-229,936,242.01
——债券投资	-113,850.00
——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	-230,050,092.01
----	-----------------

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	58,476.67
其他	-
合计	58,476.67

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,040,744.19
银行间市场交易费用	-
合计	2,040,744.19

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	69,616.82
信息披露费	149,178.12
银行划款手续费	2,419.75
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	230,214.69

6.4.3.21 分部报告

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

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议,大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金 2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、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(2016 年 4 月 25 日前)
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	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	336,010,292.26	24.96%	3,497,952,257.78	33.44%

6.4.6.1.2 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。

6.4.6.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.6.1.4 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	306,211.07	24.87%	183,405.50	22.86%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	3,159,680.54	33.46%	1,280,901.11	21.35%

注：1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2) 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,003,281.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,714,349.63	4,084,648.67

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

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,400,656.42	3,721,074.92

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

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	166,551,278.10	597,632.28	142,969,485.87	722,550.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2016 年 1 月 22 日	2016 年 1 月 22 日	0.9630	96,633,463.94	89,970,416.57	186,603,880.51	
合计	-	-	0.9630	96,633,463.94	89,970,416.57	186,603,880.51	

6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015 年 12 月 21 日	重大事项	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.27	1,386,185	16,089,580.65	25,228,567.00	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	19.22	-	-	807,990	13,192,668.83	15,529,567.80	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大事项	25.10	2016 年 7 月 4 日	22.44	235,227	5,355,936.99	5,904,197.70	-
600019	宝钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大事项	4.90	-	-	991,830	6,309,069.48	4,859,967.00	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	258,715	5,615,673.28	4,325,714.80	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项	12.44	-	-	339,387	3,963,356.65	4,221,974.28	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	8.29	-	-	489,287	5,755,991.40	4,056,189.23	-
600649	城投控股	2016 年 6 月 20 日	重大事项	14.36	-	-	255,313	2,340,063.73	3,666,294.68	-
000415	渤海金控	2016 年 2 月 1 日	重大事项	6.82	2016 年 8 月 11 日	7.50	475,596	4,203,665.23	3,243,564.72	-
000629	*ST 钒钛	2016 年 5 月 26 日	重大事项	2.39	-	-	1,004,049	3,573,557.28	2,399,677.11	-

600005	武钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大事项	2.76	-	-	715,410	4,794,511.68	1,974,531.60	-
--------	------	-----------------	------	------	---	---	---------	--------------	--------------	---

注：本基金截至 2016 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持有的证券在证券交易所上市。于本期末，除期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、债券等。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	166,551,278.10	-	-	-	166,551,278.10

结算备付金	1,122,545.12	-	-	-	1,122,545.12
存出保证金	183,772.09	-	-	-	183,772.09
交易性金融资产	-	-	-	-1,730,968,874.28	1,730,968,874.28
应收利息	-	-	-	28,815.80	28,815.80
应收申购款	9,097.15	-	-	121,161.79	130,258.94
资产总计	167,866,692.46	-	-	-1,731,118,851.87	1,898,985,544.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,600.75	16,600.75
应付赎回款	-	-	-	937,940.94	937,940.94
应付管理人报酬	-	-	-	1,155,637.08	1,155,637.08
应付托管费	-	-	-	231,127.43	231,127.43
应付交易费用	-	-	-	802,187.11	802,187.11
其他负债	-	-	-	221,313.37	221,313.37
负债总计	-	-	-	3,364,806.68	3,364,806.68
利率敏感度缺口	167,866,692.46	-	-	-1,727,754,045.19	1,895,620,737.65
上年度末 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
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

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
利率上升 25 个基点	-	-12,531.31
利率下降 25 个基点	-	12,537.58

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,730,968,874.28	91.31	2,107,191,819.17	91.62
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	1,730,968,874.28	91.31	2,107,191,819.17	91.62

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	沪深300指数上升5%	92,640,000.00	111,164,439.34
沪深300指数下降5%	-92,640,000.00	-111,164,439.34	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,730,968,874.28	91.15
	其中：股票	1,730,968,874.28	91.15
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	167,673,823.22	8.83
7	其他各项资产	342,846.83	0.02
8	合计	1,898,985,544.33	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,421,302.22	0.07
B	采矿业	60,995,747.37	3.22

C	制造业	560,375,424.62	29.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,913,704.63	3.64
E	建筑业	56,696,261.04	2.99
F	批发和零售业	38,534,061.91	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	54,691,944.29	2.89
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,421,039.02	5.40
J	金融业	613,288,509.53	32.35
K	房地产业	92,939,333.98	4.90
L	租赁和商务服务业	24,656,745.39	1.30
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	11,449,452.47	0.60
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	2,740,809.37	0.14
R	文化、体育和娱乐业	32,016,767.84	1.69
S	综合	9,827,770.60	0.52
	合计	1,730,968,874.28	91.31

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	1,841,221	58,992,720.84	3.11
2	600036	招商银行	2,068,500	36,198,750.00	1.91
3	601328	交通银行	6,207,108	34,946,018.04	1.84
4	600016	民生银行	3,853,643	34,413,031.99	1.82
5	601166	兴业银行	2,033,186	30,985,754.64	1.63
6	601939	建设银行	5,810,940	27,601,965.00	1.46
7	000002	万科A	1,386,185	25,228,567.00	1.33
8	600000	浦发银行	1,494,506	23,269,458.42	1.23
9	601169	北京银行	2,178,034	22,586,212.58	1.19

10	600519	贵州茅台	76,193	22,242,260.56	1.17
11	600030	中信证券	1,264,209	20,518,112.07	1.08
12	600837	海通证券	1,308,738	20,180,739.96	1.06
13	601601	中国太保	737,099	19,931,156.96	1.05
14	600015	华夏银行	1,825,507	18,054,264.23	0.95
15	601398	工商银行	3,818,018	16,951,999.92	0.89
16	002142	宁波银行	1,140,768	16,860,551.04	0.89
17	600887	伊利股份	980,301	16,341,617.67	0.86
18	601009	南京银行	1,730,356	16,248,042.84	0.86
19	601988	中国银行	5,038,940	16,174,997.40	0.85
20	000651	格力电器	807,990	15,529,567.80	0.82
21	601668	中国建筑	2,681,967	14,268,064.44	0.75
22	000858	五粮液	434,149	14,122,866.97	0.75
23	000333	美的集团	577,308	13,693,745.76	0.72
24	601688	华泰证券	723,501	13,688,638.92	0.72
25	000001	平安银行	1,564,000	13,606,800.00	0.72
26	601766	中国南车	1,350,052	12,379,976.84	0.65
27	600900	长江电力	979,162	12,229,733.38	0.65
28	601901	方正证券	1,576,060	12,072,619.60	0.64
29	600109	国金证券	867,680	11,696,326.40	0.62
30	600048	保利地产	1,283,887	11,079,944.81	0.58
31	600104	上汽集团	501,043	10,166,162.47	0.54
32	002594	比亚迪	162,941	9,941,030.41	0.52
33	000725	京东方 A	4,045,663	9,345,481.53	0.49
34	601989	中国重工	1,461,395	9,250,630.35	0.49
35	600705	中航资本	1,528,958	8,990,273.04	0.47
36	000776	广发证券	535,782	8,979,706.32	0.47
37	601628	中国人寿	426,139	8,872,213.98	0.47
38	600999	招商证券	537,175	8,863,387.50	0.47
39	600028	中国石化	1,870,869	8,830,501.68	0.47
40	000063	中兴通讯	615,060	8,819,960.40	0.47
41	600276	恒瑞医药	214,983	8,622,968.13	0.45
42	600518	康美药业	536,000	8,141,840.00	0.43
43	600958	东方证券	483,400	8,125,954.00	0.43
44	601211	国泰君安	452,883	8,056,788.57	0.43
45	002450	康得新	467,336	7,991,445.60	0.42
46	600383	金地集团	767,900	7,955,444.00	0.42
47	002736	国信证券	459,100	7,919,475.00	0.42
48	600340	华夏幸福	309,877	7,554,801.26	0.40

49	600816	安信信托	444,552	7,499,592.24	0.40
50	000783	长江证券	634,932	7,365,211.20	0.39
51	000768	中航飞机	370,988	7,304,753.72	0.39
52	601336	新华保险	180,006	7,272,242.40	0.38
53	600100	同方股份	485,301	7,260,102.96	0.38
54	002739	万达院线	90,600	7,238,940.00	0.38
55	300059	东方财富	325,294	7,221,526.80	0.38
56	000166	申万宏源	851,592	7,161,888.72	0.38
57	600839	四川长虹	1,615,042	7,138,485.64	0.38
58	300315	掌趣科技	677,680	7,108,863.20	0.38
59	300104	乐视网	133,800	7,079,358.00	0.37
60	002236	大华股份	532,849	6,980,321.90	0.37
61	600547	山东黄金	177,850	6,920,143.50	0.37
62	002304	洋河股份	93,422	6,718,910.24	0.35
63	002673	西部证券	259,654	6,714,652.44	0.35
64	000623	吉林敖东	267,468	6,673,326.60	0.35
65	600795	国电电力	2,253,205	6,601,890.65	0.35
66	000425	徐工机械	2,154,846	6,593,828.76	0.35
67	000895	双汇发展	304,106	6,349,733.28	0.33
68	601377	兴业证券	857,181	6,334,567.59	0.33
69	600873	梅花生物	1,009,912	6,271,553.52	0.33
70	002415	海康威视	285,595	6,128,868.70	0.32
71	000413	东旭光电	692,800	5,951,152.00	0.31
72	601390	中国中铁	853,785	5,950,881.45	0.31
73	002065	东华软件	235,227	5,904,197.70	0.31
74	002008	大族激光	257,153	5,873,374.52	0.31
75	002024	苏宁云商	538,825	5,851,639.50	0.31
76	601006	大秦铁路	907,357	5,843,379.08	0.31
77	600031	三一重工	1,151,806	5,782,066.12	0.31
78	601555	东吴证券	429,998	5,761,973.20	0.30
79	300070	碧水源	383,519	5,706,762.72	0.30
80	601099	太平洋	913,608	5,600,417.04	0.30
81	600221	海南航空	1,758,721	5,575,145.57	0.29
82	600585	海螺水泥	378,568	5,504,378.72	0.29
83	000156	华数传媒	294,432	5,461,713.60	0.29
84	601857	中国石油	755,356	5,461,223.88	0.29
85	600271	航天信息	227,950	5,425,210.00	0.29
86	600050	中国联通	1,417,636	5,401,193.16	0.28
87	601111	中国国航	797,999	5,394,473.24	0.28

88	300058	蓝色光标	553,317	5,372,708.07	0.28
89	600485	信威集团	299,457	5,342,312.88	0.28
90	600663	陆家嘴	234,619	5,337,582.25	0.28
91	601186	中国铁建	531,139	5,290,144.44	0.28
92	601607	上海医药	292,337	5,276,682.85	0.28
93	601198	东兴证券	215,700	5,271,708.00	0.28
94	000538	云南白药	81,426	5,235,691.80	0.28
95	000100	TCL 集团	1,589,326	5,228,882.54	0.28
96	600570	恒生电子	77,886	5,200,448.22	0.27
97	300017	网宿科技	76,870	5,165,664.00	0.27
98	600362	江西铜业	376,444	5,074,465.12	0.27
99	601985	中国核电	734,510	5,016,703.30	0.26
100	601899	紫金矿业	1,486,699	5,010,175.63	0.26
101	600011	华能国际	663,572	4,990,061.44	0.26
102	600068	葛洲坝	854,352	4,972,328.64	0.26
103	600690	青岛海尔	552,496	4,906,164.48	0.26
104	600688	上海石化	798,453	4,870,563.30	0.26
105	600019	宝钢股份	991,830	4,859,967.00	0.26
106	002202	金风科技	320,665	4,851,661.45	0.26
107	600196	复星医药	254,701	4,844,413.02	0.26
108	601669	中国电建	846,656	4,834,405.76	0.26
109	000729	燕京啤酒	633,053	4,804,872.27	0.25
110	000338	潍柴动力	614,746	4,801,166.26	0.25
111	002195	二三四五	389,980	4,792,854.20	0.25
112	600741	华域汽车	338,640	4,744,346.40	0.25
113	000625	长安汽车	346,400	4,735,288.00	0.25
114	601600	中国铝业	1,254,643	4,730,004.11	0.25
115	601800	中国交建	444,088	4,676,246.64	0.25
116	002230	科大讯飞	142,116	4,668,510.60	0.25
117	600415	小商品城	747,574	4,620,007.32	0.24
118	600177	雅戈尔	334,805	4,616,960.95	0.24
119	600023	浙能电力	905,957	4,611,321.13	0.24
120	000559	万向钱潮	294,328	4,591,516.80	0.24
121	601088	中国神华	324,865	4,570,850.55	0.24
122	000503	海虹控股	113,437	4,561,301.77	0.24
123	600111	北方稀土	342,054	4,552,738.74	0.24
124	600029	南方航空	642,626	4,536,939.56	0.24
125	600637	百视通	186,237	4,519,971.99	0.24
126	600893	中航动力	130,409	4,518,671.85	0.24

127	002422	科伦药业	292,996	4,515,068.36	0.24
128	600060	海信电器	255,226	4,512,395.68	0.24
129	600009	上海机场	172,137	4,484,168.85	0.24
130	000839	中信国安	210,300	4,481,493.00	0.24
131	600369	西南证券	613,892	4,456,855.92	0.24
132	000540	中天城投	714,793	4,453,160.39	0.23
133	600115	东方航空	671,620	4,439,408.20	0.23
134	300024	机器人	174,164	4,422,023.96	0.23
135	000686	东北证券	341,187	4,404,724.17	0.23
136	601258	庞大集团	1,588,958	4,369,634.50	0.23
137	601872	招商轮船	929,996	4,352,381.28	0.23
138	000046	泛海控股	429,262	4,339,838.82	0.23
139	300251	光线传媒	375,072	4,335,832.32	0.23
140	000728	国元证券	258,715	4,325,714.80	0.23
141	000423	东阿阿胶	81,783	4,320,595.89	0.23
142	600010	包钢股份	1,506,026	4,307,234.36	0.23
143	600089	特变电工	501,061	4,269,039.72	0.23
144	000963	华东医药	63,064	4,250,513.60	0.22
145	002465	海格通信	339,387	4,221,974.28	0.22
146	600066	宇通客车	213,174	4,220,845.20	0.22
147	300027	华谊兄弟	307,514	4,163,739.56	0.22
148	600867	通化东宝	199,242	4,122,316.98	0.22
149	600406	国电南瑞	308,042	4,118,521.54	0.22
150	600718	东软集团	224,508	4,112,986.56	0.22
151	000792	盐湖股份	194,487	4,103,675.70	0.22
152	001979	招商蛇口	286,379	4,080,900.75	0.22
153	601618	中国中冶	1,105,538	4,079,435.22	0.22
154	600352	浙江龙盛	472,674	4,074,449.88	0.21
155	002129	中环股份	489,287	4,056,189.23	0.21
156	600804	鹏博士	221,607	4,039,895.61	0.21
157	002241	歌尔声学	140,752	4,036,767.36	0.21
158	002500	山西证券	241,678	4,002,187.68	0.21
159	600583	海油工程	574,886	3,972,462.26	0.21
160	000402	金融街	400,597	3,893,802.84	0.21
161	600489	中金黄金	342,584	3,850,644.16	0.20
162	601117	中国化学	695,439	3,845,777.67	0.20
163	601179	中国西电	752,570	3,815,529.90	0.20
164	300146	汤臣倍健	280,920	3,803,656.80	0.20
165	000009	中国宝安	277,207	3,797,735.90	0.20

166	600895	张江高科	208,337	3,766,732.96	0.20
167	600674	川投能源	454,924	3,757,672.24	0.20
168	600685	广船国际	146,900	3,725,384.00	0.20
169	600535	天士力	103,436	3,698,871.36	0.20
170	600170	上海建工	965,020	3,696,026.60	0.19
171	600118	中国卫星	109,778	3,688,540.80	0.19
172	601933	永辉超市	892,774	3,687,156.62	0.19
173	600153	建发股份	306,659	3,679,908.00	0.19
174	600061	国投安信	206,100	3,672,702.00	0.19
175	600332	白云山	148,843	3,667,491.52	0.19
176	600649	城投控股	255,313	3,666,294.68	0.19
177	600703	三安光电	183,444	3,663,376.68	0.19
178	600157	永泰能源	928,109	3,656,749.46	0.19
179	002292	奥飞娱乐	121,876	3,650,186.20	0.19
180	600150	中国船舶	163,089	3,630,361.14	0.19
181	600098	广州发展	462,000	3,612,840.00	0.19
182	600886	国投电力	547,290	3,612,114.00	0.19
183	000917	电广传媒	218,214	3,607,077.42	0.19
184	000630	铜陵有色	1,420,035	3,606,888.90	0.19
185	601018	宁波港	726,802	3,597,669.90	0.19
186	601919	中国远洋	701,700	3,564,636.00	0.19
187	300144	宋城演艺	142,191	3,541,977.81	0.19
188	000750	国海证券	477,418	3,528,119.02	0.19
189	601727	上海电气	466,400	3,525,984.00	0.19
190	000778	新兴铸管	758,285	3,518,442.40	0.19
191	601333	广深铁路	899,741	3,517,987.31	0.19
192	601888	中国国旅	79,408	3,492,363.84	0.18
193	000977	浪潮信息	146,906	3,444,945.70	0.18
194	600863	内蒙华电	1,134,072	3,424,897.44	0.18
195	000060	中金岭南	327,102	3,411,673.86	0.18
196	600074	保千里	228,550	3,409,966.00	0.18
197	600739	辽宁成大	218,478	3,401,702.46	0.18
198	002456	欧菲光	114,963	3,391,408.50	0.18
199	600027	华电国际	679,785	3,364,935.75	0.18
200	000876	新希望	403,958	3,360,930.56	0.18
201	002252	上海莱士	88,488	3,334,227.84	0.18
202	002399	海普瑞	190,829	3,331,874.34	0.18
203	000568	泸州老窖	109,502	3,252,209.40	0.17
204	000415	渤海金控	475,596	3,243,564.72	0.17

205	601216	内蒙君正	431,216	3,221,183.52	0.17
206	600309	万华化学	183,212	3,169,567.60	0.17
207	600660	福耀玻璃	225,716	3,160,024.00	0.17
208	002007	华兰生物	100,477	3,154,977.80	0.17
209	002475	立讯精密	159,438	3,132,956.70	0.17
210	600446	金证股份	86,700	3,116,865.00	0.16
211	000069	华侨城 A	487,004	3,116,825.60	0.16
212	002146	荣盛发展	461,215	3,099,364.80	0.16
213	000712	锦龙股份	148,336	3,079,455.36	0.16
214	000061	农产品	252,234	3,067,165.44	0.16
215	600208	新湖中宝	719,045	3,041,560.35	0.16
216	002385	大北农	375,012	3,022,596.72	0.16
217	600578	京能电力	702,547	3,006,901.16	0.16
218	600252	中恒集团	692,261	3,004,412.74	0.16
219	002183	怡亚通	209,400	2,998,608.00	0.16
220	600256	广汇能源	721,655	2,958,785.50	0.16
221	601991	大唐发电	755,218	2,937,798.02	0.15
222	300124	汇川技术	150,989	2,929,186.60	0.15
223	603000	人民网	175,614	2,916,948.54	0.15
224	000800	一汽轿车	266,923	2,904,122.24	0.15
225	600875	东方电气	295,312	2,899,963.84	0.15
226	600398	海澜之家	253,329	2,862,617.70	0.15
227	600037	歌华有线	184,800	2,810,808.00	0.15
228	300003	乐普医疗	153,716	2,803,779.84	0.15
229	600582	天地科技	618,812	2,784,654.00	0.15
230	300002	神州泰岳	259,714	2,763,356.96	0.15
231	600008	首创股份	704,598	2,740,886.22	0.14
232	300015	爱尔眼科	75,029	2,740,809.37	0.14
233	600018	上港集团	536,457	2,735,930.70	0.14
234	601992	金隅股份	350,895	2,719,436.25	0.14
235	600827	百联股份	222,411	2,686,724.88	0.14
236	000157	中联重科	635,857	2,626,089.41	0.14
237	000826	启迪桑德	85,953	2,625,864.15	0.14
238	600737	中粮屯河	226,200	2,612,610.00	0.14
239	300085	银之杰	86,946	2,599,685.40	0.14
240	002081	金螳螂	257,652	2,581,673.04	0.14
241	601225	陕西煤业	497,708	2,573,150.36	0.14
242	600085	同仁堂	86,187	2,567,510.73	0.14
243	603993	洛阳钼业	616,044	2,556,582.60	0.13

244	600820	隧道股份	298,126	2,501,277.14	0.13
245	000039	中集集团	175,396	2,485,361.32	0.13
246	601866	中海集运	621,994	2,463,096.24	0.13
247	600998	九州通	140,432	2,458,964.32	0.13
248	600588	用友网络	123,993	2,427,782.94	0.13
249	600600	青岛啤酒	82,763	2,405,920.41	0.13
250	000629	*ST 钒钛	1,004,049	2,399,677.11	0.13
251	002424	贵州百灵	138,900	2,389,080.00	0.13
252	600606	绿地控股	219,594	2,376,007.08	0.13
253	600038	中直股份	56,234	2,332,586.32	0.12
254	000709	河钢股份	835,241	2,313,617.57	0.12
255	000738	中航动控	87,225	2,302,740.00	0.12
256	600783	鲁信创投	104,734	2,263,301.74	0.12
257	600642	申能股份	387,948	2,226,821.52	0.12
258	000027	深圳能源	348,593	2,224,023.34	0.12
259	600376	首开股份	199,200	2,215,104.00	0.12
260	002294	信立泰	81,350	2,212,720.00	0.12
261	002470	金正大	269,032	2,165,707.60	0.11
262	600372	中航电子	110,442	2,150,305.74	0.11
263	601106	中国一重	412,200	2,147,562.00	0.11
264	601098	中南传媒	116,891	2,116,896.01	0.11
265	600871	石化油服	549,300	2,109,312.00	0.11
266	601998	中信银行	361,647	2,050,538.49	0.11
267	601718	际华集团	260,300	1,988,692.00	0.10
268	002152	广电运通	120,566	1,982,105.04	0.10
269	600373	中文传媒	95,504	1,981,708.00	0.10
270	600005	武钢股份	715,410	1,974,531.60	0.10
271	002027	分众传媒	112,800	1,862,328.00	0.10
272	600188	兖州煤业	166,371	1,820,098.74	0.10
273	601633	长城汽车	211,737	1,787,060.28	0.09
274	600021	上海电力	170,973	1,755,892.71	0.09
275	601021	春秋航空	35,762	1,714,430.28	0.09
276	000999	华润三九	69,458	1,682,272.76	0.09
277	300133	华策影视	107,880	1,679,691.60	0.09
278	601898	中煤能源	324,609	1,674,982.44	0.09
279	600317	营口港	492,053	1,653,298.08	0.09
280	002153	石基信息	60,960	1,608,124.80	0.08
281	601928	凤凰传媒	141,961	1,496,268.94	0.08
282	601016	节能风电	149,200	1,481,556.00	0.08

283	600704	物产中大	158,040	1,479,254.40	0.08
284	601118	海南橡胶	254,258	1,421,302.22	0.07
285	601958	金钼股份	172,395	1,405,019.25	0.07
286	600648	外高桥	70,618	1,391,880.78	0.07
287	601608	中信重工	255,194	1,370,391.78	0.07
288	600666	奥瑞德	39,000	1,355,640.00	0.07
289	000883	湖北能源	284,591	1,317,656.33	0.07
290	000825	太钢不锈	413,900	1,307,924.00	0.07
291	600959	江苏有线	91,149	1,272,440.04	0.07
292	601808	中海油服	100,855	1,225,388.25	0.06
293	000898	鞍钢股份	312,654	1,197,464.82	0.06
294	600022	山东钢铁	479,400	1,136,178.00	0.06
295	300168	万达信息	35,443	921,163.57	0.05
296	603885	吉祥航空	31,200	819,000.00	0.04
297	002568	百润股份	34,500	759,000.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	17,932,673.75	0.78
2	002142	宁波银行	14,359,602.77	0.62
3	601988	中国银行	13,088,152.48	0.57
4	601009	南京银行	12,464,196.06	0.54
5	601169	北京银行	10,658,995.65	0.46
6	601377	兴业证券	9,722,441.25	0.42
7	600015	华夏银行	8,705,811.78	0.38
8	601939	建设银行	8,704,251.00	0.38
9	000001	平安银行	7,880,447.70	0.34
10	600109	国金证券	7,452,101.00	0.32
11	600816	安信信托	7,273,477.48	0.32
12	601601	中国太保	6,974,356.09	0.30
13	001979	招商蛇口	6,494,859.64	0.28
14	600887	伊利股份	6,189,900.00	0.27
15	601998	中信银行	5,975,377.20	0.26
16	600000	浦发银行	5,947,030.00	0.26

17	601901	方正证券	5,775,996.69	0.25
18	000540	中天城投	5,228,862.64	0.23
19	002739	万达院线	5,167,102.00	0.22
20	601318	中国平安	4,804,960.00	0.21

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601169	北京银行	17,200,583.32	0.75
2	600000	浦发银行	16,231,611.80	0.71
3	600036	招商银行	12,989,206.75	0.56
4	600016	民生银行	11,545,938.00	0.50
5	601998	中信银行	11,115,963.00	0.48
6	601988	中国银行	9,840,801.00	0.43
7	601166	兴业银行	9,094,698.09	0.40
8	601377	兴业证券	8,783,595.14	0.38
9	601318	中国平安	8,758,069.45	0.38
10	000001	平安银行	8,561,412.90	0.37
11	601009	南京银行	8,214,823.75	0.36
12	600887	伊利股份	7,763,248.81	0.34
13	000046	泛海控股	7,049,190.29	0.31
14	601398	工商银行	7,038,694.00	0.31
15	601766	中国中车	6,893,259.10	0.30
16	601688	华泰证券	6,705,437.99	0.29
17	001979	招商蛇口	6,550,454.00	0.28
18	601238	广汽集团	6,352,126.01	0.28
19	601328	交通银行	6,152,323.07	0.27
20	600030	中信证券	6,064,909.00	0.26

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	659,744,842.07
卖出股票收入（成交）总额	690,239,907.98

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

7.8 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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	183,772.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,815.80
5	应收申购款	130,258.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	342,846.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	25,228,567.00	1.33	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
134,984	15,286.70	7,642,446.05	0.37%	2,055,817,303.12	99.63%

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	665,936.77	0.0323%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年4月6日）基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额	1,928,620,557.68
本报告期基金总申购份额	237,075,126.47
减：本报告期基金总赎回份额	102,235,934.98
本报告期期末基金份额总额	2,063,459,749.17

§ 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2016年6月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	336,010,292.26	24.96%	306,211.07	24.87%	-
平安证券	1	211,639,284.57	15.72%	197,098.58	16.01%	-
中金公司	2	172,256,424.67	12.80%	156,976.09	12.75%	-
中信建投	2	153,426,182.97	11.40%	139,816.72	11.36%	-
海通证券	1	100,096,717.85	7.44%	91,219.21	7.41%	-
中泰证券	1	84,546,833.89	6.28%	77,047.67	6.26%	-
中信证券	2	82,266,994.87	6.11%	74,969.58	6.09%	-
华泰证券	1	81,847,542.05	6.08%	74,588.19	6.06%	-
招商证券	2	65,912,652.98	4.90%	60,067.29	4.88%	-
兴业证券	2	31,538,735.69	2.34%	28,741.29	2.33%	-
方正证券	1	26,709,666.47	1.98%	24,340.47	1.98%	-
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%	-
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%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	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%	-
爱建证券	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%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	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：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、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：爱建证券，东方证券，万和证券。

本报告期内退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 12 日
2	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
3	大成沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
4	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
5	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 27 日
6	大成沪深 300 指数证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 5 日
7	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 18 日
8	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 22 日
9	大成沪深 300 指数证券投资基金	中国证监会指定报	2016 年 3 月 26 日

	2015 年年度报告	刊及本公司网站	
10	大成沪深 300 指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
11	大成基金管理有限公司关于公司 旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 12 日
12	大成沪深 300 指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 22 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下 基金实行网上直销申购费率优惠 的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 4 月 23 日
14	大成基金管理有限公司关于公司 旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 11 日
15	大成沪深 300 指数证券投资基金 更新招募说明书(2016 年第 1 期)	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 20 日
16	大成沪深 300 指数证券投资基金 更新招募说明书(2016 年第 1 期) -摘要	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 20 日
17	大成基金管理有限公司关于基金 经理暂停履职的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 5 月 26 日
18	大成基金关于旗下部分基金增加 汉口银行股份有限公司为代销机 构的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日
19	大成基金管理有限公司关于因指 数熔断调整公司旗下部分公募基 金开放时间的公告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 5 日
20	关于旗下场内基金在指数熔断期 间暂停申购赎回业务的提示性公 告	中国证监会指定报 刊及本公司网站	2016 年 1 月 6 日

21	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 8 日
22	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 18 日
23	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 30 日
24	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 18 日
25	大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 27 日
26	大成基金管理有限公司关于增加北京葱次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
27	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 12 日
28	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 17 日
29	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 18 日

	的公告		
30	大成基金管理有限公司关于增加万和证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
31	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 29 日
32	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 18 日
33	大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
34	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 30 日
35	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
36	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 5 日
37	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 7 日
38	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日

	有限公司为代销机构的公告		
39	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 17 日
40	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 22 日
41	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东大会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司
2016年8月25日