

大成纳斯达克 100 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	31
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	41

7.11 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金
基金简称	大成纳斯达克 100 指数 QDII
基金主代码	000834
交易代码	000834
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 13 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,366,887.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道	北京市东城区建国门内大街 69

	7088 号招商银行大厦 32 层	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	周慕冰

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-81,361.82
本期利润	-385,002.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0373
本期加权平均净值利润率	-3.40%

本期基金份额净值增长率	-3.55%
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	1,194,143.33
期末可供分配基金份额利润	0.1152
期末基金资产净值	11,561,030.33
期末基金份额净值	1.115
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	11.50%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

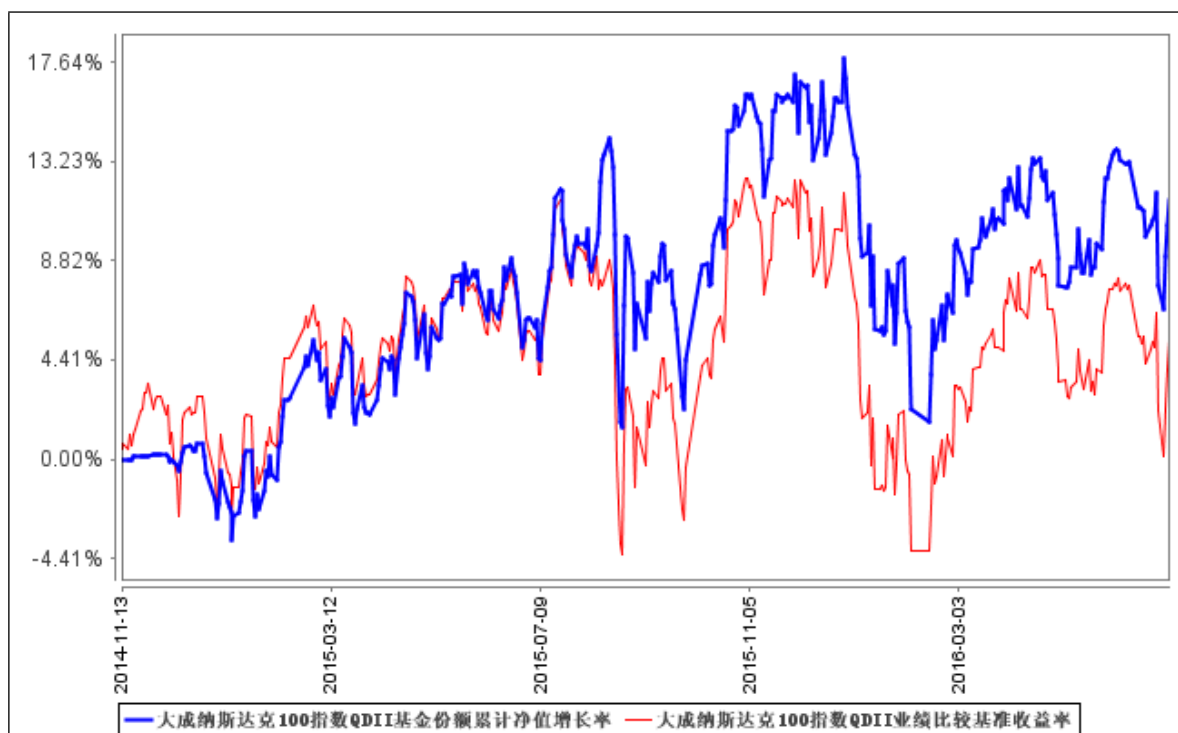
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.93%	1.19%	-2.35%	1.42%	0.42%	-0.23%
过去三个月	0.00%	0.98%	-1.47%	1.08%	1.47%	-0.10%
过去六个月	-3.55%	1.19%	-3.82%	1.29%	0.27%	-0.10%
过去一年	5.89%	1.26%	0.48%	1.32%	5.41%	-0.06%
自基金合同生效起至今	11.50%	1.10%	5.30%	1.18%	6.20%	-0.08%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



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

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，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		
冉凌浩先	本基金	2014 年	-	13 年	金融学硕士。2003 年 4 月至

生	基金经 理	11 月 13 日			2004 年 6 月就职于国信证券研究部，任研究员；2004 年 6 月至 2005 年 9 月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005 年 9 月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日起担任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。2014 年 11 月 13 日起担任大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 国籍：中国
---	----------	--------------	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成纳斯达克 100 指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 年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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，全球金融市场出现大幅震荡。

1 月份，从发达国家市场到新兴市场，从股票市场到大宗商品市场，都出现了快速且大幅的下跌。下跌的原因在于对全球需求增长放缓的担忧以及随之引发的对欧洲银行体系稳定性的担忧。同时，如果新兴市场及欧洲与日本的需求都放缓，也会影响到美国企业，因此美国股市也出现了明显下跌。

2 月份开始，恐慌情绪逐渐消散，市场开始向正常水平恢复。大宗商品出现了较为强烈的反弹，这提振了市场对于以原材料出口为主的新兴市场国家的信心，从而导致全球股市都出现了反弹。

6 月底，英国举行公投，其结果为“脱离欧盟”。公投结果公布后，对全球金融市场造成了较大的动荡，各大股票市场都出现了明显的短期下跌。对于全球经济而言，由于英国脱欧的过程较为漫长和杂，因此其确切的影响较难准确估算，但总体上来说英国脱欧这一政治事件会对英国和欧盟的经济产生负面影响。

从美国自身来看，年初海外市场的动荡引发了对美国经济增长的担忧，但是，其后公布各类美国宏观经济数据表明，美国受海外经济波动的影响并不大，宏观经济依然保持了正增长。进入到 2 季度，美国宏观经济表现虽然较为平淡，但仍保持在正增长的轨迹上。

具体来看，美国的企业投资、居民消费、营建支出和商品贸易都保持增长。同时，因就业率维持高位，居民收入大幅上升，而通胀维持低位，消费支出低于收入增速，美国储蓄率上升至近

年来最高水平。即使在英国退出欧盟过程中，美国经济受到的影响也相对较小。

由于英国“脱欧”事件，美联储对于加息表现更为审慎，当前预计 2016 年仅还有一次加息机会。虽然加息预期降低，但由于欧洲不稳定性增强，因此美元预计仍会保持强势。

上半年，美元相对于人民币继续保持升值的趋势，这有利于本基金净值的表现。

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.115 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.55%，同期业绩比较基准收益率为-3.82%，高于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年，全球宏观波动性有望减少，但经济增速有可能进一步下降。从欧洲来看，虽然有英国脱欧事件的影响，但欧元区仍然有望保持正增长，虽然经济增长速度会非常低，如欧元区二季度 GDP 季环比增速的初值为 0.3%。

受全球需求放缓的影响，美国的宏观经济增速也在低位徘徊，但仍然保持正增长。美国二季度 GDP 增长率初值为 1.2%，其中私人消费增长 4.2%，保持稳健，而由于去库存周期，投资出现下降，成为 GDP 主要拖累。

目前来看美国生产企业已经连续 5 个季度去库存，这已经明显长于以往的去库存周期，并且 2 季度企业去库存出现进一步加速。近期零售商则已开始补库存，同时企业产能利用率近期也开始有所回升，这都意味着接下来若消费增长得以维持，企业去库存接近尾声转而进入补库存的概率似乎正在逐渐上升，而这可能会推动未来企业部门出现阶段性的改善。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

理。

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 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：大成纳斯达克 100 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	876,867.58	1,136,881.55
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	10,650,615.96	11,237,460.84
其中：股票投资		10,650,615.96	11,237,460.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
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	20.46	97.76
应收股利		3,791.12	4,619.61
应收申购款		393,982.45	127,804.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	133,348.26	-

资产总计		12,058,625.83	12,506,864.31
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		313,156.43	132,686.85
应付赎回款		40,323.62	284,703.83
应付管理人报酬		7,260.40	8,320.71
应付托管费		2,268.87	2,600.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	134,586.18	140,675.67
负债合计		497,595.50	568,987.29
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	10,366,887.00	10,327,107.74
未分配利润	6.4.3.10	1,194,143.33	1,610,769.28
所有者权益合计		11,561,030.33	11,937,877.02
负债和所有者权益总计		12,058,625.83	12,506,864.31

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.115 元，基金份额总额 10,366,887.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-99,085.62	9,922,282.56
1. 利息收入		1,357.45	63,585.71
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,357.45	63,578.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	7.22
2. 投资收益（损失以“-”填列）		184,343.15	7,067,731.58

其中：股票投资收益	6.4.3.12	113,935.54	6,527,538.77
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	70,407.61	540,192.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-303,640.37	857,883.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		13,856.47	1,687,706.11
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	4,997.68	245,375.55
减：二、费用		285,916.57	862,561.91
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	44,992.10	392,233.79
2. 托管费	6.4.6.2.2	14,060.08	122,573.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	707.75	54,598.24
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.21	226,156.64	293,156.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-385,002.19	9,059,720.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-385,002.19	9,059,720.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成纳斯达克 100 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）	10,327,107.74	1,610,769.28	11,937,877.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-385,002.19	-385,002.19
三、本期基金份额交易	39,779.26	-31,623.76	8,155.50

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)			
其中: 1.基金申购款	4,161,563.76	427,754.52	4,589,318.28
2.基金赎回款	-4,121,784.50	-459,378.28	-4,581,162.78
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)	10,366,887.00	1,194,143.33	11,561,030.33
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	198,897,170.16	-1,287,588.11	197,609,582.05
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期净利润)	-	9,059,720.65	9,059,720.65
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	-182,829,107.04	-6,917,113.27	-189,746,220.31
其中: 1.基金申购款	6,278,437.53	271,911.67	6,550,349.20
2.基金赎回款	-189,107,544.57	-7,189,024.94	-196,296,569.51
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	16,068,063.12	855,019.27	16,923,082.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

罗登攀
基金管理人负责人

周立新
主管会计工作负责人

范瑛
会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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	876,867.58
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	876,867.58

注：于 2016 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 107,180.48 元，折合人民币 710,735.20 元。

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	9,613,564.36	10,650,615.96	1,037,051.60
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	9,613,564.36	10,650,615.96	1,037,051.60

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。

6.4.3.5 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	20.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	20.46

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	133,348.26
合计	133,348.26

6.4.3.7 应付交易费用

本基金于本期末无应付交易费用。

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	104.52
预提费用	134,481.66
合计	134,586.18

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	10,327,107.74	10,327,107.74
本期申购	4,161,563.76	4,161,563.76
本期赎回(以“-”号填列)	-4,121,784.50	-4,121,784.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,366,887.00	10,366,887.00

6.4.3.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,864,647.35	-253,878.07	1,610,769.28
本期利润	-81,361.82	-303,640.37	-385,002.19
本期基金份额交易产生的变动数	9,363.33	-40,987.09	-31,623.76
其中：基金申购款	727,468.35	-299,713.83	427,754.52
基金赎回款	-718,105.02	258,726.74	-459,378.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,792,648.86	-598,505.53	1,194,143.33

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	1,357.45
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	-
其他	-
合计	1,357.45

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	1,322,425.64
减：卖出股票成本总额	1,208,490.10
买卖股票差价收入	113,935.54

6.4.3.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

6.4.3.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.3.15 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.16 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.17 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	70,407.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	70,407.61

6.4.3.18 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	-303,640.37
——股票投资	-303,640.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-303,640.37

6.4.3.19 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	4,997.68
合计	4,997.68

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。

6.4.3.20 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	707.75
银行间市场交易费用	-
合计	707.75

6.4.3.21 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	19,890.78
信息披露费	74,590.88
银行汇划费	1,823.05
指数授权费	129,851.93
合计	226,156.64

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

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至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、注册登记机构、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东(2016年4月25日前)
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,992.10	392,233.79
其中：支付销售机构的客户维护费	17,174.46	181,320.17

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.8% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,060.08	122,573.03

注：支付基金托管人中国农行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.6.4 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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.6.5 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
纽约梅隆	710,324.53	-	2,493.49	-
中国农行	166,543.05	1,357.45	759,268.08	29,578.49

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

6.4.6.6 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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行

存款存放在本基金的托管行中国农业银行及境外次托管行纽约梅隆，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

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

6.4.9.4.1.1 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年至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	876,867.58	-	-	-	876,867.58
交易性金融资产	-	-	-	10,650,615.96	10,650,615.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	20.46	20.46
应收股利	-	-	-	3,791.12	3,791.12
应收申购款	253,423.76	-	-	140,558.69	393,982.45
其他资产	-	-	-	133,348.26	133,348.26
资产总计	1,130,291.34	-	-	10,928,334.49	12,058,625.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	313,156.43	313,156.43
应付赎回款	-	-	-	40,323.62	40,323.62
应付管理人报酬	-	-	-	7,260.40	7,260.40
应付托管费	-	-	-	2,268.87	2,268.87
其他负债	-	-	-	134,586.18	134,586.18
负债总计	-	-	-	497,595.50	497,595.50
利率敏感度缺口	1,130,291.34	-	-	10,430,738.99	11,561,030.33
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1年至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,136,881.55	-	-	-	1,136,881.55
交易性金融资产	-	-	-	11,237,460.84	11,237,460.84
应收利息	-	-	-	97.76	97.76
应收股利	-	-	-	4,619.61	4,619.61
应收申购款	5,051.86	-	-	122,752.69	127,804.55
资产总计	1,141,933.41	-	-	11,364,930.90	12,506,864.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	132,686.85	132,686.85
应付赎回款	-	-	-	284,703.83	284,703.83

应付管理人报酬	-	-	-	8,320.71	8,320.71
应付托管费	-	-	-	2,600.23	2,600.23
其他负债	-	-	-	140,675.67	140,675.67
负债总计	-	-	-	568,987.29	568,987.29
利率敏感度缺口	1,141,933.41	-	-	10,795,943.61	11,937,877.02

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日本基金未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	710,735.20	-	-	710,735.20
交易性金融资产	10,650,615.96	-	-	10,650,615.96
应收股利	3,791.12	-	-	3,791.12
其它资产	133,348.26	-	-	133,348.26
资产合计	11,498,490.54	-	-	11,498,490.54
以外币计价的负债				
应付证券清算款	313,156.43	-	-	313,156.43
负债合计	313,156.43	-	-	313,156.43
资产负债表外汇风险敞口净额	11,185,334.11	-	-	11,185,334.11
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	718,773.20	-	-	718,773.20
交易性金融资产	11,237,460.84	-	-	11,237,460.84
应收股利	4,619.61	-	-	4,619.61

资产合计	11,960,853.65	-	-	11,960,853.65
以外币计价的负债				
应付证券清算款	132,686.85	-	-	132,686.85
负债合计	132,686.85	-	-	132,686.85
资产负债表外汇风险敞口净额	11,828,166.80	-	-	11,828,166.80

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 56	增加约 59
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 56	减少约 59

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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.9.4.3.1 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	10,650,615.96	92.13	11,237,460.84	94.13
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	10,650,615.96	92.13	11,237,460.84	94.13

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 55	增加约 78
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 55	减少约 78

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	10,650,615.96	88.32
	其中: 普通股票	10,650,615.96	88.32
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中: 债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中: 远期	-	0.00

	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	876,867.58	7.27
8	其他各项资产	531,142.29	4.40
9	合计	12,058,625.83	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	10,650,615.96	92.13
合计	10,650,615.96	92.13

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	5,972,662.11	51.66
消费者非必需品	2,353,241.72	20.35
医疗保健	1,280,245.00	11.07
消费者常用品	790,178.64	6.83
工业	201,689.28	1.74
电信服务	52,599.21	0.45
金融	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
基础材料	0.00	0.00
合计	10,650,615.96	92.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	1,766	1,119,542.84	9.68
2	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	2,535	860,172.41	7.44
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	152	721,303.74	6.24
4	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	US	745	564,571.08	4.88
5	Google Inc C	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	110	504,839.89	4.37
6	Google Inc A	谷歌公司	GOOG L UQ	纳斯达克交易所	US	94	438,533.32	3.79
7	Comcast Corp	康卡斯特	CMCS A UQ	纳斯达克交易所	US	779	336,752.30	2.91
8	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	US	1,523	331,257.62	2.87
9	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,622	308,584.09	2.67
10	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	US	242	244,162.77	2.11
11	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	429	237,311.95	2.05
12	KRAFT HEINZ CO	卡夫亨氏	KHC UQ	纳斯达克交易所	US	392	229,997.60	1.99
13	Walgreens Boots Alliance	沃尔格林公司	WBA UQ	纳斯达克交易所	US	334	184,428.13	1.60

14	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	453	171,584.69	1.48
15	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	454	161,275.96	1.39
16	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	US	239	156,314.43	1.35
17	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	US	480	144,857.24	1.25
18	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易所	US	134	139,542.73	1.21
19	Priceline.com Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达克交易所	US	16	132,455.30	1.15
20	Avago Technologies Ltd	安华高科技公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	US	125	128,811.06	1.11
21	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	310	128,787.85	1.11
22	Biogen Idec Inc	生化基因	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	67	107,438.30	0.93
23	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	195	98,015.77	0.85
24	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	152	96,550.80	0.84
25	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU UQ	纳斯达克交易所	US	84	91,991.99	0.80
26	PAYPAL HLDGS INC	支付宝控股有限公司	PYPL UQ	纳斯达克交易所	US	375	90,789.42	0.79
27	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	140	85,289.17	0.74
28	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	137	83,107.24	0.72

				所				
29	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克 交易所	US	304	75,716.63	0.65
30	T-MOBILE UQ INC	T-Mobile 公 司	TMUS UQ	纳斯达克 交易所	US	263	75,463.12	0.65
31	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技 公司	CTSH UQ	纳斯达克 交易所	US	195	74,016.13	0.64
32	Regeneron Pharmaceutical s	雷杰纳荣制 药	REGN UQ	纳斯达克 交易所	US	31	71,790.23	0.62
33	Monster Beverage Corp	Monster 饮 料公司	MNST UQ	纳斯达克 交易所	US	65	69,270.51	0.60
34	TESLA MOTORS INC	特斯拉汽车 公司	TSLA UQ	纳斯达克 交易所	US	47	66,160.54	0.57
35	ACTIVISION BLIZZARD INC	ACTIVISION BLIZZARD 公 司	ATVI UQ	纳斯达克 交易所	US	236	62,019.49	0.54
36	21st Century Fox	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克 交易所	US	339	60,807.77	0.53
37	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克 交易所	US	78	57,728.44	0.50
38	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导 体	NXPI UQ	纳斯达克 交易所	US	111	57,663.19	0.50
39	Alexion Pharmaceutical s Inc	Alexion 制 药公司	ALXN UQ	纳斯达克 交易所	US	72	55,746.64	0.48
40	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克 交易所	US	355	55,108.92	0.48
41	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克 交易所	US	337	53,566.10	0.46
42	CSX Corporation	CSX 公司	CSX UQ	纳斯达克 交易所	US	309	53,438.98	0.46
43	O'Reilly	奥莱利汽车	ORLY	纳斯达克	US	29	52,133.83	0.45

	Automotive		UQ	克交易所				
44	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	165	51,435.90	0.44
45	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	71	51,191.74	0.44
46	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	99	49,735.59	0.43
47	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	130	48,869.95	0.42
48	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	11	48,245.36	0.42
49	CHARTER COMMUNICATION-A	特许通讯公司	CHTR UQ	纳斯达克交易所	US	31	47,000.88	0.41
50	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	72	44,994.55	0.39
51	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	新闻集团	FOX UQ	纳斯达克交易所	US	244	44,090.85	0.38
52	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	110	43,401.20	0.38
53	Mylan Inc.	麦兰医药	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	150	43,009.96	0.37
54	SIRIUS XM HOLDINGS INC	SIRIUS XM 公司	SIRI UQ	纳斯达克交易所	US	1,637	42,878.33	0.37
55	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	75	42,781.19	0.37
56	ILLUMINA INC	ILLUMINA 公司	ILMN UQ	纳斯达克交易所	US	44	40,959.07	0.35
57	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	104	40,413.19	0.35

58	JD.COM INC-ADR	京东	JD UQ	纳斯达克交易所	US	267	37,588.36	0.33
59	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	107	36,803.76	0.32
60	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空	AAL UQ	纳斯达克交易所	US	193	36,231.75	0.31
61	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	95	35,681.16	0.31
62	LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	LIBERTY GLOBAL 公司	LBTY K UQ	纳斯达克交易所	US	186	35,337.00	0.31
63	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	US	77	33,934.64	0.29
64	NETEASE INC-ADR	网易	NTES UQ	纳斯达克交易所	US	24	30,750.73	0.27
65	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	埃尔塔美发化妆香水商店	ULTA UQ	纳斯达克交易所	US	19	30,696.89	0.27
66	HENRY SCHEIN INC	亨利施恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	US	26	30,482.30	0.26
67	INCYTE CORP	英赛德药学公司	INCY UQ	纳斯达克交易所	US	57	30,230.71	0.26
68	Expedia	Expedia 公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	42	29,605.66	0.26
69	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	106	29,149.56	0.25
70	CHECK POINT SOFTWARE TECH	CHECK POINT 软件科技	CHKP UQ	纳斯达克交易所	US	55	29,060.57	0.25
71	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	US	318	29,016.01	0.25
72	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	US	133	28,954.41	0.25

				所				
73	CTrip.com INTERNATIONAL- ADR	携程网	CTRP UQ	纳斯达克 交易所	US	105	28,686.57	0.25
74	VERISK ANALYTICS INC- CLASS A	VERISK ANALYTICS 公司	VRSK UQ	纳斯达克 交易所	US	51	27,420.54	0.24
75	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克 交易所	US	200	27,240.97	0.24
76	Tractor Supply Co	Tractor Supply 公司	TSCO UQ	纳斯达克 交易所	US	45	27,208.48	0.24
77	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	SBA 通信公 司	SBAC UQ	纳斯达克 交易所	US	38	27,199.33	0.24
78	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克 交易所	US	92	27,081.03	0.23
79	Lam Research Corp	Lam Research 公 司	LRCX UQ	纳斯达克 交易所	US	48	26,756.10	0.23
80	DISH NETWORK CORP-A	DISH NETWORK 公司	DISH UQ	纳斯达克 交易所	US	76	26,408.09	0.23
81	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克 交易所	US	49	26,023.55	0.23
82	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	沃达丰集团	VOD UQ	纳斯达克 交易所	US	124	25,399.88	0.22
83	BIOMARIN PHARMAC	BIOMARIN 制 药公司	BMRN UQ	纳斯达克 交易所	US	49	25,279.46	0.22
84	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克 交易所	US	69	24,771.91	0.21
85	Western Digital Corp	西部数据公 司	WDC UQ	纳斯达克 交易所	US	78	24,444.46	0.21
86	SKYWORKS SOLUTIONS	思佳讯解决 方案	SWKS UQ	纳斯达克 交易所	US	58	24,338.10	0.21
87	Mattel Inc	美泰	MAT	纳斯达克	US	115	23,861.38	0.21

			UQ	克交易所				
88	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	78	23,859.99	0.21
89	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	LIBERTY INTERACTIVE 公司	QVCA UQ	纳斯达克交易所	US	140	23,552.70	0.20
90	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信集成产品	MXIM UQ	纳斯达克交易所	US	98	23,193.42	0.20
91	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	73	22,524.13	0.19
92	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	104	22,082.43	0.19
93	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	30	20,713.22	0.18
94	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	54	20,027.68	0.17
95	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	46	19,613.76	0.17
96	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	挪威游轮	NCLH UQ	纳斯达克交易所	US	69	18,228.90	0.16
97	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	US	106	17,284.49	0.15
98	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	100	16,153.60	0.14
99	LIBERTY GLOBAL PLC-A	LIBERTY GLOBAL 公司	LBTY A UQ	纳斯达克交易所	US	77	14,838.11	0.13
100	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	50	14,330.02	0.12
101	Discovery Communications C	探索传播公司	DISC K UQ	纳斯达克交易所	US	77	12,177.87	0.11

102	LIBERTY VENTURES - SER A	LIBERTY VENTURES 公司	LVNT A UQ	纳斯达克交易所	US	47	11,553.47	0.10
103	Discovery Communications A	探索传播公司	DISC A UQ	纳斯达克交易所	US	53	8,867.17	0.08
104	Endo International plc	远藤制药	ENDP UQ	纳斯达克交易所	US	78	8,063.67	0.07

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Amazon.com Inc	AMZN UQ	78,153.60	0.65
2	Microsoft Corp	MSFT UQ	67,328.52	0.56
3	Alphabet Inc C	GOOG UQ	64,540.29	0.54
4	CSX Corporation	CSX UQ	55,320.76	0.46
5	Facebook Inc A	FB UQ	45,716.59	0.38
6	Apple Inc.	AAPL UQ	44,953.44	0.38
7	Alphabet Inc A	GOOGL UQ	42,215.29	0.35
8	Comcast Corp A	CMCSA UQ	38,471.33	0.32
9	Broadcom Limited	AVGO UQ	37,548.55	0.31
10	Gilead Sciences Inc	GILD UQ	31,827.58	0.27
11	NETEASE INC-ADR	NTES UQ	30,637.74	0.26
12	Endo International plc	ENDP UQ	29,457.27	0.25
13	Ulta Salon Cosmetics & Fragr	ULTA UQ	25,278.98	0.21
14	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NCLH UQ	24,651.09	0.21
15	The Priceline Group Inc	PCLN UQ	23,990.43	0.20
16	Cisco Systems Inc	CSCO UQ	23,357.80	0.20
17	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	MXIM UQ	20,433.80	0.17
18	Amgen Inc	AMGN UQ	18,290.25	0.15
19	The Kraft Heinz Company	KHC UQ	17,256.86	0.14
20	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI UQ	15,438.93	0.13

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Apple Inc.	AAPL UQ	140,191.95	1.17
2	Microsoft Corp	MSFT UQ	115,096.54	0.96
3	Alphabet Inc C	GOOG UQ	66,421.10	0.56
4	Amazon.com Inc	AMZN UQ	66,010.61	0.55
5	Alphabet Inc A	GOOGL UQ	53,429.59	0.45
6	Gilead Sciences Inc	GILD UQ	52,556.55	0.44
7	Facebook Inc A	FB UQ	52,472.38	0.44
8	Comcast Corp A	CMCSA UQ	39,059.92	0.33
9	Cisco Systems Inc	CSCO UQ	36,951.14	0.31
10	SanDisk Corp	SNDK UQ	33,782.74	0.28
11	Amgen Inc	AMGN UQ	29,365.10	0.25
12	Intel Corp	INTC UQ	26,187.76	0.22
13	KLA-Tencor Corporation	KLAC UQ	23,634.00	0.20
14	Starbucks Corp	SBUX UQ	23,382.15	0.20
15	The Kraft Heinz Company	KHC UQ	23,077.99	0.19
16	Celgene Corp	CELG UQ	22,391.16	0.19
17	QUALCOMM Inc	QCOM UQ	22,261.34	0.19
18	Mondelez International Inc	MDLZ UQ	19,410.51	0.16
19	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	18,240.10	0.15
20	Biogen Inc	BIIB UQ	17,206.77	0.14

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	925,285.58
卖出收入（成交）总额	1,322,425.64

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,791.12
4	应收利息	20.46
5	应收申购款	393,982.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	133,348.26
8	其他	-
9	合计	531,142.29

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

7.11.5.1 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
938	11,052.12	131,252.30	1.27%	10,235,634.70	98.73%

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	10,477.69	0.1011%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年11月13日）基金份额总额	474,326,755.60
本报告期期初基金份额总额	10,327,107.74
本报告期基金总申购份额	4,161,563.76
减：本报告期基金总赎回份额	4,121,784.50
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	10,366,887.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

摩根士丹利	1	2,247,711.22	100.00%	694.94	100.00%	-
-------	---	--------------	---------	--------	---------	---

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用境内证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

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

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度（包括但不限于公平交易制度及保密制度），能满足各投资组合运作高度保密的要求；
- （五）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；
- （六）具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- （七）具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- （八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- （九）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

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

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

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

4、本报告期内本基金无退租或新增的境内交易单元，无新增或退租境外交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 16 日
2	大成纳斯达克 100 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	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 4 日
4	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 2 月 5 日
5	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 23 日
6	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
7	大成纳斯达克 100 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
8	大成纳斯达克 100 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
9	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 27 日

10	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 28 日
11	大成纳斯达克 100 指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 28 日
12	关于大成基金管理有限公司在京东商城基金直销店铺开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 29 日
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 1 日
21	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
22	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
23	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		
24	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
25	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
26	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
27	大成基金管理来有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 4 月 27 日
28	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
29	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
30	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
31	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
32	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 5 月 10 日
33	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
34	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
35	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纳斯达克 100 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日