

大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金  
2015 年年度报告摘要  
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示

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

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 7 月 8 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 大成正向回报灵活配置混合     |
| 基金主代码      | 001365           |
| 交易代码       | 001365           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2015 年 7 月 8 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 | 320,546,406.79 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在保持资产流动性的基础上，通过严格控制组合下行风险，力争实现基金资产稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金的资产配置目标是严格控制组合的下行风险，主要控制方式一是分析宏观经济形势和各类型资产价格变化趋势，灵活调整债券、股票等资产的投资比例，规避或减小某一类资产的趋势下行对组合的影响；二是对股票类风险资产坚持绝对收益投资理念，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，结合定性与定量分析，选择具有长期持续增长能力的公司。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款利率+2%  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。   |

### 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       |

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)-<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | -69,521,405.06                               |
| 本期利润          | -43,339,904.70                               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1262                                      |
| 本期基金份额净值增长率   | -10.90%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末                                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1898                                      |
| 期末基金资产净值      | 285,689,763.75                               |
| 期末基金份额净值      | 0.891  |

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。

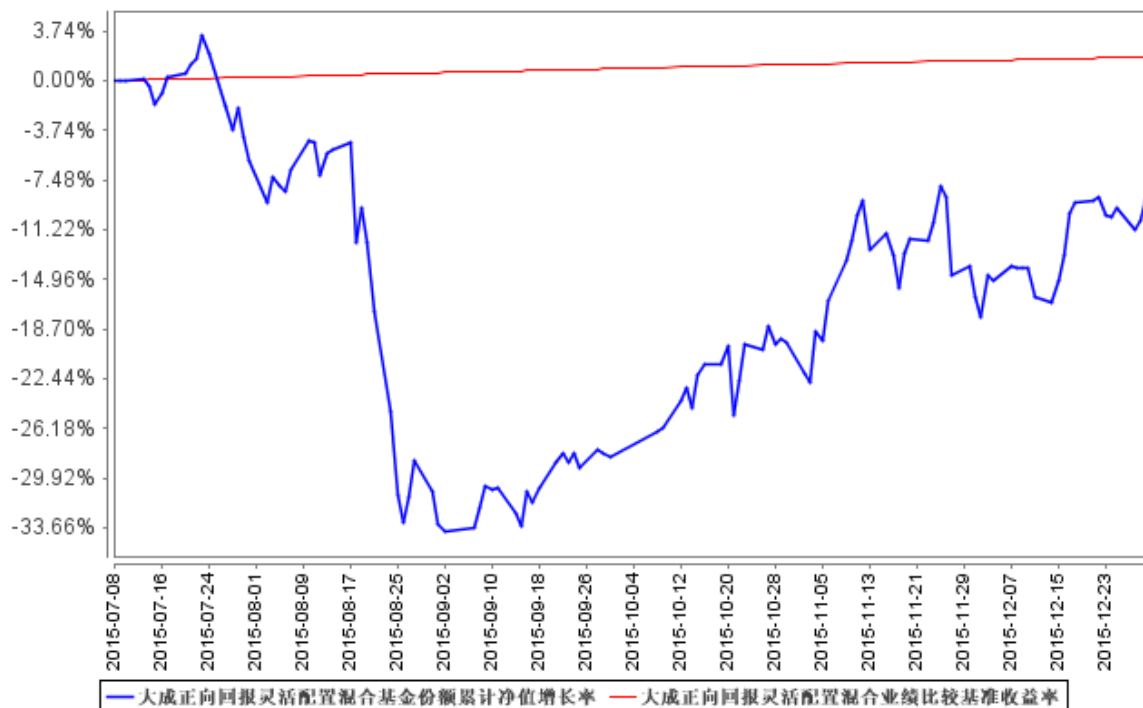
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 24.27%   | 2.38%       | 0.89%      | 0.01%         | 23.38%  | 2.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.90%  | 2.61%       | 1.80%      | 0.01%         | -12.70% | 2.60% |

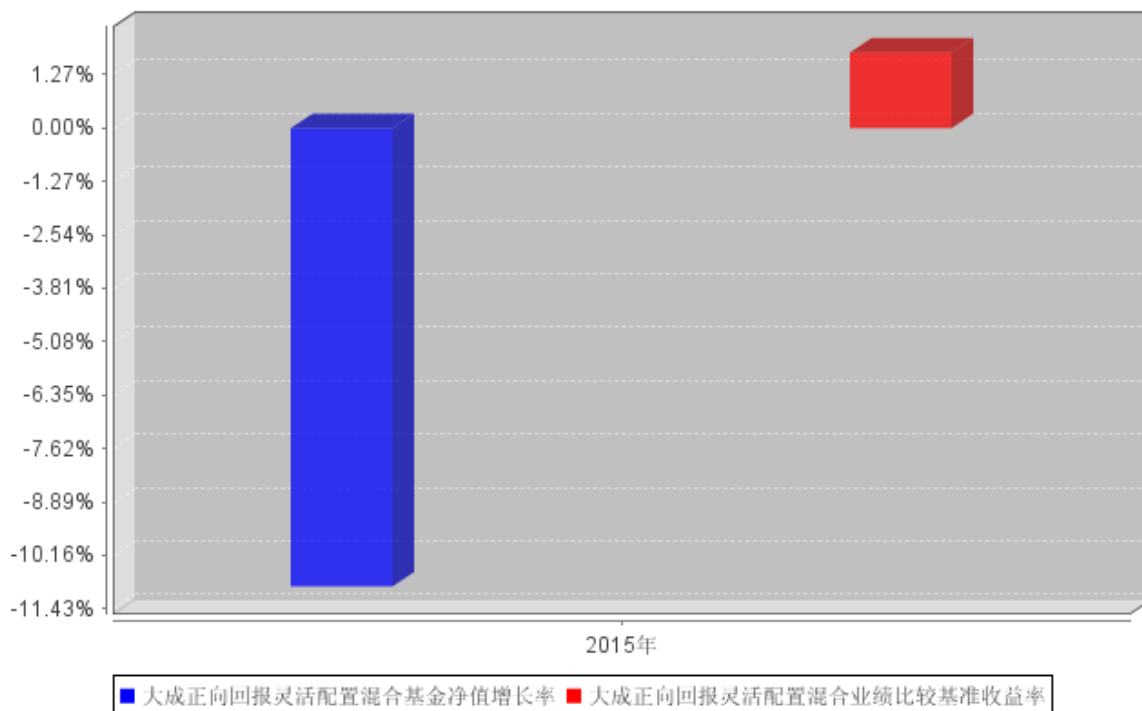
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2015 年 7 月 8 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015 年净值增长率表现期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名   | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|------|---------|-----------------|------|--------|---|
|      |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 杨挺先生 | 本基金基金经理 | 2015 年 7 月 8 日  | -    | 8 年    | 工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员；2012 年 8 月起任职于大成基金管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014 年 3 月 18 日 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 起任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 21 日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 8 日任大成正向回报灵活配置混合型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 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》、《大成正向回报灵活配置混合型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，大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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



理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 130 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年的 A 股市场波动可谓惊心动魄，上证综指上下波动区间高达 2300 点（最低 2850，最高 5178），创业板指数上下波动区间高达 2600 点（最低 1429，最高 4037）。其中 6 月至 8 月，A 股投资者经历了中国股市目前罕见的深幅调整。不过总体来看，截止 12 月 18 日，各大类板块均在 2015 年录得向上的涨幅。从行业表现来看，2015 年表现最好的是新兴行业（如计算机、传媒等）和一些转型重组较多的传统行业（如轻工制造、纺织服装等）。

本基金进入三季度后开始建仓。进入三季度后，市场波动幅度明显加剧，7 月中旬国家开始救市措施以后，市场初步企稳，当时我们低估了杠杆资金出清的力量，也低估了市场的恐慌情绪，依然保持了较高仓位，因此在 8 月中旬指数从 4000 点快速跌落到 3000 点的过程中损失较重。之后我们判断市场杠杆资金已经出清，市场的悲观情绪已经过度释放，加上货币政策继续保持宽松，因此我们大胆参与了 9 月的反弹行情，挽回了部分损失。

四季度我们基本延续 9 月以来的操作思路，比较充分的享受了 10 月行情带来的回报，10 月以后，市场进入震荡期，指数表现上停滞不前，不过主题和个股依然保持了较为活跃的状态，因

此我们在 11、12 月依然保持了较高仓位，主要配置长期看好的一些标的，兼顾参与了部分主题，也获得了不错的效果。

总体来说，今年我们对市场风格和主题的把握是比较成功的，所挑选的标的也得到了市场的印证，但是，在下半年市场波动最大的几个月中，我们低估了杠杆出清带来的连锁反应，其中对于仓位和风控的探讨，值得我们长期思考和学习。

#### 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 0.891 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.90%，同期业绩比较基准收益率为 1.80%，低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

2016 年投资者最关注利率水平的变动，并且普遍认为只要中国的利率水平能够继续维持低位，则会带来“资产配置荒”，充裕的资金会增加股票配置，从而提升 A 股估值。

首先，针对“利率能否下台阶”这个问题，答案是肯定的。明年随着财政支出动力的减弱和地产小周期的结束，宏观经济可能再下台阶。具体来看，2016 年上半年，在“稳增长”政策和地产投资恢复的带动下，经济有望维持弱稳定；2016 年下半年，随着财政支出后继乏力、地产周期结束、传统行业供给收缩，经济再次“下台阶”。而随着经济下台阶，利率水平也将进一步下台阶。

但是，利率下台阶并不意味着估值水平一定会提升。从海外经验来看，利率下行并不是股市上涨的充分条件。以美国和日本为例，90 年代同样是利率下台阶，从盈利来看美日企业差异巨大，美国的非金融上市公司 ROE（净资产收益率）明显高于贷款利率，企业供给扩张动力强，而日本虽然贷款利率持续下降，但 ROE（净资产收益率）也持续走低，企业供给扩张动力弱。从风险偏好来看，美日两国投资者对本国中长期产业前景的信心同样有很大差异。具体来说，美国国民对信息产业和金融的产业转型方向充满乐观，而日本在“地产泡沫”破裂后，虽然地价大幅下跌，但地产占 GDP 的比重仍在上升，这显示出日本国民经济缺少新的增长动力，国民看不到日本产业转型的希望。在这样的背景下，90 年代，美国居民储蓄意愿较弱，更倾向于配置风险资产，日本居民储蓄意愿较强，更倾向于配置避险资产。因此，即使“钱多”，也不会有“资产配置荒”，关键取决于居民是配置风险资产还是避险资产。

未来中国经济与 A 股市场面临的一个问题是，当前市场热议的“供给侧改革”已经进入了“深水区”，需要处理一些尖锐矛盾之间的冲突与平衡——长期供给改革和短期保增长的矛盾、大规模减税和化解政府债务的矛盾。当前传统重工业对中国国民经济依然有较强支撑作用，产能

加速出清容易导致经济增长显著下滑，这和短期的“保增长”政策可能形成潜在冲突。“供给侧改革”的另一重要精髓是减税，减税的背后是财政赤字的大幅增加，解决办法是大规模发行国债。而这就需要面临处理政府债务积累与全球对中国经济增长预期之间平衡的问题。期待政策能够化解这些问题，这将提振资本市场投资者对中长期转型和改革深化的预期。

针对市场走势，如果假设 2016 年利率水平还是向下，接下来关键取决于盈利趋势和风险偏好。就盈利趋势来看，新兴行业的外延收购能够保证正增长但增速可能放缓，传统行业的盈利趋势则取决于供给端变化，目前传统行业由于资产周转率的下滑 ROE（净资产收益率）已降至历史最低水平，接下来如果提升资产周转率需要将资产增速降为负，但资产负债增长会对宏观经济造成严重冲击，这可能需与“保增长”目标之间做一些平衡。就风险偏好来看，A 股投资者的风险偏好取决于转型和改革的推进力度。从产业转型来看，传统产业需求饱和、产能过剩，需要向新兴行业转型；从体制改革来看，行政管制束缚了经济发展的活力，需要放松管制、提升效率。

当前新兴行业盈利趋势尚可，但短期估值中枢需要有一个向下修复的过程；传统行业估值相对合理，但短期盈利趋势尚难改善。因此，中期慢牛之前，A 股短期可能会先经历一个估值和盈利的修复过程。

在行业配置方面，新兴行业中关注内生增长动力最强的消费服务业，在人均 GDP 提升和人口结构变迁的背景下，这是中国未来最为确定的产业发展方向，在消费服务业中应着重关注医疗服务、教育、传媒、信息服务等。针对传统行业，如果没有供给端的明显收缩，那么传统行业的 ROE（净资产收益率）将很难升，在这些领域里边作为次选标的可以关注制造业投资显著下降的传统行业，如煤炭、有色、钢铁、化纤等。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 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一大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

本基金 2015 年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|
| <b>资 产:</b>     |                         |
| 银行存款            | 40,253,730.62           |
| 结算备付金           | 2,830,502.93            |
| 存出保证金           | 729,333.35              |
| 交易性金融资产         | 252,431,748.96          |
| 其中：股票投资         | 252,431,748.96          |
| 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          | -                       |
| 买入返售金融资产        | -                       |
| 应收证券清算款         | -                       |
| 应收利息            | 6,238.57                |
| 应收股利            | -                       |
| 应收申购款           | -                       |
| 递延所得税资产         | -                       |
| 其他资产            | -                       |
| 资产总计            | 296,251,554.43          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>              |

|               | 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|
| <b>负 债:</b>   |                  |
| 短期借款          | -                |
| 交易性金融负债       | -                |
| 衍生金融负债        | -                |
| 卖出回购金融资产款     | -                |
| 应付证券清算款       | 8,187,396.36     |
| 应付赎回款         | 434,208.58       |
| 应付管理人报酬       | 360,829.30       |
| 应付托管费         | 60,138.22        |
| 应付销售服务费       | -                |
| 应付交易费用        | 1,418,140.14     |
| 应交税费          | -                |
| 应付利息          | -                |
| 应付利润          | -                |
| 递延所得税负债       | -                |
| 其他负债          | 101,078.08       |
| 负债合计          | 10,561,790.68    |
| <b>所有者权益:</b> |                  |
| 实收基金          | 320,546,406.79   |
| 未分配利润         | -34,856,643.04   |
| 所有者权益合计       | 285,689,763.75   |
| 负债和所有者权益总计    | 296,251,554.43   |

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.891 元，基金份额总额 320,546,406.79 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间，截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目         | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|
| <b>一、收入</b> | -36,895,294.37                                      |
| 1. 利息收入     | 392,876.80  |
| 其中：存款利息收入   | 392,876.80  |
| 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                     | -                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -63,607,089.11        |
| 其中：股票投资收益                  | -63,646,352.80        |
| 基金投资收益                     | -                     |
| 债券投资收益                     | -                     |
| 资产支持证券投资收益                 | -                     |
| 贵金属投资收益                    | -                     |
| 衍生工具收益                     | -                     |
| 股利收益                       | 39,263.69             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 26,181,500.36         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 137,417.58            |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>6,444,610.33</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 2,078,840.77          |
| 2. 托管费                     | 346,473.43            |
| 3. 销售服务费                   | -                     |
| 4. 交易费用                    | 3,862,190.02          |
| 5. 利息支出                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     |
| 6. 其他费用                    | 157,106.11            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-43,339,904.70</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-43,339,904.70</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |                |                |
|--------------------------|---|----------------|----------------|
|                          | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）          | 368,738,178.20                                  | -              | 368,738,178.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -   | -43,339,904.70 | -43,339,904.70 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | -48,191,771.41                                  | 8,483,261.66   | -39,708,509.75 |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |                |                |                |
| 其中：1. 基金申购款                            | 6,113,790.67   | -990,352.45    | 5,123,438.22   |
| 2. 基金赎回款                               | -54,305,562.08 | 9,473,614.11   | -44,831,947.97 |
| 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）                        | 320,546,406.79 | -34,856,643.04 | 285,689,763.75 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |             |
|--------------|--------------|-------------|
| _____<br>罗登攀 | _____<br>周立新 | _____<br>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     |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 868 号《关于准予大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 368,541,517.80 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 890 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 368,738,178.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 196,660.40 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票等权益类占基金资产的比例为 0%-



95%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系               |
|------------------------|-----------------------|
| 大成基金管理有限公司(“大成基金”)     | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”) | 基金托管人、基金销售机构          |

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 中泰信托有限责任公司             | 基金管理人的股东        |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 中国银河投资管理有限公司           | 基金管理人的股东        |
| 广东证券股份有限公司(“广东证券”)     | 基金管理人的股东        |
| 大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)   | 基金管理人的子公司       |
| 大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”) | 基金管理人的合营企业      |

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

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |                  |
|-------|---|------------------|
|       | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 光大证券  | 18,275,868.95                                   | 0.69%            |

###### 7.4.8.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |                |           |                  |
|-------|--------------------------------------|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                             | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 光大证券  | 16,654.76                            | 0.69%          | 16,654.76 | 1.17%            |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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

务等。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月<br>31日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,078,840.77                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 986,835.04                               |

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 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% ÷ 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月<br>31日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 346,473.43                               |

注：支付基金托管人中国农业银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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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<br>名称 | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|-----------|--------------------------------------|
|-----------|--------------------------------------|

|        | 期末余额          | 当期利息收入     |
|--------|---------------|------------|
| 中国农业银行 | 40,253,730.62 | 373,815.17 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600122 | 宏图高科 | 2015年12月25日 | 重大事项   | 19.42  | -    | -      | 601,700 | 11,124,085.14 | 11,685,014.00 | -  |
| 600584 | 长电科技 | 2015年11月30日 | 重大资产重组 | 22.02  | -    | -      | 254,300 | 5,680,171.00  | 5,599,686.00  | -  |

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目      | 金额             | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资    | 252,431,748.96 | 85.21        |
|    | 其中：股票   | 252,431,748.96 | 85.21        |
| 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      | 43,084,233.55  | 14.54  |
| 7 | 其他各项资产            | 735,571.92     | 0.25   |
| 8 | 合计                | 296,251,554.43 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -              | 0.00         |
| C  | 制造业              | 181,645,828.52 | 63.58        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -              | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 38,435,966.84  | 13.45        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,195,928.00   | 2.87         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 24,154,025.60  | 8.45         |
| J  | 金融业              | -              | 0.00         |
| K  | 房地产业             | -              | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | 0.00         |
| 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    | -              | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | 0.00         |
| P  | 教育               | -              | 0.00         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | 0.00         |
| S  | 综合               | -              | 0.00         |
|    | 合计               | 252,431,748.96 | 88.36        |

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末未持有沪港通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 002355 | 兴民钢圈 | 1,361,100 | 27,303,666.00 | 9.56         |
| 2  | 300078 | 思创医惠 | 530,384   | 25,882,739.20 | 9.06         |
| 3  | 000078 | 海王生物 | 768,579   | 18,415,152.84 | 6.45         |
| 4  | 300109 | 新开源  | 166,500   | 17,324,325.00 | 6.06         |
| 5  | 002019 | 亿帆鑫富 | 404,900   | 16,196,000.00 | 5.67         |
| 6  | 000952 | 广济药业 | 647,800   | 14,899,400.00 | 5.22         |
| 7  | 002730 | 电光科技 | 243,810   | 11,980,823.40 | 4.19         |
| 8  | 002517 | 泰亚股份 | 194,964   | 11,803,120.56 | 4.13         |
| 9  | 600122 | 宏图高科 | 601,700   | 11,685,014.00 | 4.09         |
| 10 | 600520 | 中发科技 | 369,600   | 10,304,448.00 | 3.61         |

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.defund.com.cn>)的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 000722 | 湖南发展 | 44,059,688.09 | 15.42          |
| 2  | 002019 | 亿帆鑫富 | 35,664,333.69 | 12.48          |
| 3  | 300109 | 新开源  | 29,276,769.00 | 10.25          |
| 4  | 000938 | 紫光股份 | 27,838,115.00 | 9.74           |
| 5  | 000078 | 海王生物 | 26,232,322.81 | 9.18           |
| 6  | 300078 | 思创医惠 | 20,644,088.00 | 7.23           |
| 7  | 002572 | 索菲亚  | 20,575,427.98 | 7.20           |
| 8  | 002355 | 兴民钢圈 | 20,028,446.75 | 7.01           |
| 9  | 002517 | 泰亚股份 | 19,609,274.71 | 6.86           |
| 10 | 000910 | 大亚科技 | 17,613,991.84 | 6.17           |
| 11 | 300147 | 香雪制药 | 17,495,245.41 | 6.12           |
| 12 | 300464 | 星徽精密 | 17,494,794.80 | 6.12           |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 13 | 002422 | 科伦药业   | 16,788,749.00 | 5.88 |
| 14 | 600520 | 中发科技   | 16,663,554.70 | 5.83 |
| 15 | 000926 | 福星股份   | 16,586,427.78 | 5.81 |
| 16 | 600303 | 曙光股份   | 15,709,745.41 | 5.50 |
| 17 | 300017 | 网宿科技   | 15,609,531.47 | 5.46 |
| 18 | 000952 | 广济药业   | 15,365,944.02 | 5.38 |
| 19 | 000796 | 凯撒旅游   | 14,945,145.69 | 5.23 |
| 20 | 601009 | 南京银行   | 14,328,233.20 | 5.02 |
| 21 | 002085 | 万丰奥威   | 14,289,562.97 | 5.00 |
| 22 | 600518 | 康美药业   | 14,103,758.00 | 4.94 |
| 23 | 002175 | 东方网络   | 14,084,590.92 | 4.93 |
| 24 | 002366 | 台海核电   | 14,027,648.07 | 4.91 |
| 25 | 600804 | 鹏博士    | 13,878,427.20 | 4.86 |
| 26 | 600998 | 九州通    | 13,485,859.00 | 4.72 |
| 27 | 000776 | 广发证券   | 13,372,737.08 | 4.68 |
| 28 | 300244 | 迪安诊断   | 13,324,699.00 | 4.66 |
| 29 | 300432 | 富临精工   | 13,075,686.45 | 4.58 |
| 30 | 300255 | 常山药业   | 12,972,580.42 | 4.54 |
| 31 | 000100 | TCL 集团 | 12,385,051.00 | 4.34 |
| 32 | 600521 | 华海药业   | 12,248,380.40 | 4.29 |
| 33 | 300250 | 初灵信息   | 12,103,858.14 | 4.24 |
| 34 | 600418 | 江淮汽车   | 11,600,130.18 | 4.06 |
| 35 | 300064 | 豫金刚石   | 11,593,350.31 | 4.06 |
| 36 | 002730 | 电光科技   | 11,520,294.00 | 4.03 |
| 37 | 600343 | 航天动力   | 11,326,347.00 | 3.96 |
| 38 | 000028 | 国药一致   | 11,267,016.16 | 3.94 |
| 39 | 600172 | 黄河旋风   | 11,134,824.00 | 3.90 |
| 40 | 600122 | 宏图高科   | 11,124,085.14 | 3.89 |
| 41 | 600276 | 恒瑞医药   | 11,054,782.22 | 3.87 |
| 42 | 300178 | 腾邦国际   | 11,005,636.94 | 3.85 |
| 43 | 300284 | 苏交科    | 10,848,969.82 | 3.80 |
| 44 | 002584 | 西陇科学   | 10,791,255.35 | 3.78 |
| 45 | 300395 | 菲利华    | 10,773,340.81 | 3.77 |
| 46 | 600572 | 康恩贝    | 10,542,170.89 | 3.69 |
| 47 | 300136 | 信维通信   | 10,513,441.00 | 3.68 |
| 48 | 600017 | 日照港    | 10,512,858.00 | 3.68 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 49 | 600055 | 华润万东 | 10,510,029.00 | 3.68 |
| 50 | 300098 | 高新兴  | 10,455,958.20 | 3.66 |
| 51 | 002113 | 天润控股 | 10,430,428.61 | 3.65 |
| 52 | 002421 | 达实智能 | 10,416,888.02 | 3.65 |
| 53 | 600750 | 江中药业 | 10,293,122.00 | 3.60 |
| 54 | 300427 | 红相电力 | 10,189,638.00 | 3.57 |
| 55 | 600108 | 亚盛集团 | 10,094,105.00 | 3.53 |
| 56 | 300161 | 华中数控 | 10,078,401.74 | 3.53 |
| 57 | 002299 | 圣农发展 | 10,073,688.12 | 3.53 |
| 58 | 300166 | 东方国信 | 10,049,473.67 | 3.52 |
| 59 | 002071 | 长城影视 | 9,999,730.00  | 3.50 |
| 60 | 002547 | 春兴精工 | 9,888,953.00  | 3.46 |
| 61 | 603885 | 吉祥航空 | 9,560,306.65  | 3.35 |
| 62 | 002354 | 天神娱乐 | 9,456,507.00  | 3.31 |
| 63 | 002429 | 兆驰股份 | 9,103,691.60  | 3.19 |
| 64 | 300331 | 苏大维格 | 9,002,109.07  | 3.15 |
| 65 | 600826 | 兰生股份 | 8,779,836.00  | 3.07 |
| 66 | 002599 | 盛通股份 | 8,756,772.66  | 3.07 |
| 67 | 000516 | 国际医学 | 8,705,784.00  | 3.05 |
| 68 | 600478 | 科力远  | 8,701,336.83  | 3.05 |
| 69 | 300390 | 天华超净 | 8,653,794.64  | 3.03 |
| 70 | 000802 | 北京文化 | 8,605,268.00  | 3.01 |
| 71 | 002117 | 东港股份 | 8,559,516.68  | 3.00 |
| 72 | 002467 | 二六三  | 8,552,106.00  | 2.99 |
| 73 | 002364 | 中恒电气 | 8,543,153.56  | 2.99 |
| 74 | 002583 | 海能达  | 8,468,709.04  | 2.96 |
| 75 | 002279 | 久其软件 | 8,457,621.22  | 2.96 |
| 76 | 600079 | 人福医药 | 8,358,954.00  | 2.93 |
| 77 | 600461 | 洪城水业 | 8,206,467.52  | 2.87 |
| 78 | 002667 | 鞍重股份 | 8,185,786.00  | 2.87 |
| 79 | 002381 | 双箭股份 | 7,977,752.99  | 2.79 |
| 80 | 002701 | 奥瑞金  | 7,974,930.39  | 2.79 |
| 81 | 600837 | 海通证券 | 7,950,514.00  | 2.78 |
| 82 | 601688 | 华泰证券 | 7,932,797.97  | 2.78 |
| 83 | 300203 | 聚光科技 | 7,870,003.27  | 2.75 |
| 84 | 002044 | 江苏三友 | 7,545,382.08  | 2.64 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 85  | 300329 | 海伦钢琴   | 7,448,626.36 | 2.61 |
| 86  | 002089 | 新海宜    | 7,384,069.23 | 2.58 |
| 87  | 000030 | 富奥股份   | 7,326,752.20 | 2.56 |
| 88  | 600420 | 现代制药   | 7,286,760.48 | 2.55 |
| 89  | 600038 | 中直股份   | 7,273,930.92 | 2.55 |
| 90  | 600990 | 四创电子   | 7,219,495.50 | 2.53 |
| 91  | 300364 | 中文在线   | 7,199,805.00 | 2.52 |
| 92  | 002450 | 康得新    | 7,020,066.82 | 2.46 |
| 93  | 300450 | 先导智能   | 7,007,473.00 | 2.45 |
| 94  | 600217 | *ST 秦岭 | 6,858,986.98 | 2.40 |
| 95  | 000797 | 中国武夷   | 6,853,881.99 | 2.40 |
| 96  | 600963 | 岳阳林纸   | 6,803,420.00 | 2.38 |
| 97  | 002674 | 兴业科技   | 6,776,056.74 | 2.37 |
| 98  | 002234 | 民和股份   | 6,765,576.87 | 2.37 |
| 99  | 300209 | 天泽信息   | 6,734,236.90 | 2.36 |
| 100 | 601012 | 隆基股份   | 6,733,443.00 | 2.36 |
| 101 | 002363 | 隆基机械   | 6,723,754.00 | 2.35 |
| 102 | 002157 | 正邦科技   | 6,711,026.01 | 2.35 |
| 103 | 002022 | 科华生物   | 6,704,735.00 | 2.35 |
| 104 | 000411 | 英特集团   | 6,697,092.72 | 2.34 |
| 105 | 002714 | 牧原股份   | 6,677,828.00 | 2.34 |
| 106 | 002226 | 江南化工   | 6,035,101.58 | 2.11 |
| 107 | 300299 | 富春通信   | 5,870,450.25 | 2.05 |
| 108 | 002458 | 益生股份   | 5,861,388.00 | 2.05 |
| 109 | 600815 | 厦工股份   | 5,800,352.00 | 2.03 |
| 110 | 000687 | 华讯方舟   | 5,775,064.00 | 2.02 |
| 111 | 002548 | 金新农    | 5,749,118.22 | 2.01 |

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 000722 | 湖南发展 | 37,128,188.06 | 13.00          |
| 2  | 000938 | 紫光股份 | 28,319,564.95 | 9.91           |
| 3  | 002085 | 万丰奥威 | 22,939,637.39 | 8.03           |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 4  | 002572 | 索菲亚    | 21,598,973.28 | 7.56 |
| 5  | 300464 | 星徽精密   | 19,297,093.01 | 6.75 |
| 6  | 000910 | 大亚科技   | 18,076,077.47 | 6.33 |
| 7  | 002019 | 亿帆鑫富   | 17,756,307.86 | 6.22 |
| 8  | 300432 | 富临精工   | 17,184,035.65 | 6.01 |
| 9  | 002517 | 泰亚股份   | 16,614,188.38 | 5.82 |
| 10 | 300147 | 香雪制药   | 15,981,538.77 | 5.59 |
| 11 | 002422 | 科伦药业   | 15,396,431.18 | 5.39 |
| 12 | 600303 | 曙光股份   | 15,226,839.56 | 5.33 |
| 13 | 002175 | 东方网络   | 14,902,168.25 | 5.22 |
| 14 | 300017 | 网宿科技   | 14,358,003.78 | 5.03 |
| 15 | 000776 | 广发证券   | 14,001,753.29 | 4.90 |
| 16 | 300255 | 常山药业   | 13,813,586.88 | 4.84 |
| 17 | 000926 | 福星股份   | 13,660,302.81 | 4.78 |
| 18 | 601009 | 南京银行   | 13,435,359.84 | 4.70 |
| 19 | 300250 | 初灵信息   | 13,396,961.80 | 4.69 |
| 20 | 300109 | 新开源    | 13,298,313.27 | 4.65 |
| 21 | 000100 | TCL 集团 | 12,405,030.00 | 4.34 |
| 22 | 000796 | 凯撒旅游   | 12,065,574.11 | 4.22 |
| 23 | 600343 | 航天动力   | 12,052,348.23 | 4.22 |
| 24 | 300244 | 迪安诊断   | 11,989,033.45 | 4.20 |
| 25 | 000028 | 国药一致   | 11,748,469.28 | 4.11 |
| 26 | 002113 | 天润控股   | 11,688,149.50 | 4.09 |
| 27 | 300064 | 豫金刚石   | 11,602,332.38 | 4.06 |
| 28 | 600521 | 华海药业   | 11,404,461.86 | 3.99 |
| 29 | 600518 | 康美药业   | 10,793,677.70 | 3.78 |
| 30 | 600572 | 康恩贝    | 10,708,686.75 | 3.75 |
| 31 | 600461 | 洪城水业   | 10,659,989.60 | 3.73 |
| 32 | 600750 | 江中药业   | 10,644,175.91 | 3.73 |
| 33 | 300284 | 苏交科    | 10,620,593.34 | 3.72 |
| 34 | 300395 | 菲利华    | 10,608,176.24 | 3.71 |
| 35 | 300178 | 腾邦国际   | 10,515,783.56 | 3.68 |
| 36 | 600998 | 九州通    | 10,242,812.74 | 3.59 |
| 37 | 600418 | 江淮汽车   | 10,164,810.11 | 3.56 |
| 38 | 600276 | 恒瑞医药   | 10,085,792.52 | 3.53 |
| 39 | 300331 | 苏大维格   | 10,045,469.61 | 3.52 |
| 40 | 600804 | 鹏博士    | 9,999,792.00  | 3.50 |
| 41 | 603885 | 吉祥航空   | 9,981,486.87  | 3.49 |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 42 | 002366 | 台海核电   | 9,978,444.72 | 3.49 |
| 43 | 002429 | 兆驰股份   | 9,874,738.96 | 3.46 |
| 44 | 300078 | 思创医惠   | 9,749,680.84 | 3.41 |
| 45 | 300390 | 天华超净   | 9,699,991.13 | 3.40 |
| 46 | 002354 | 天神娱乐   | 9,591,665.40 | 3.36 |
| 47 | 600826 | 兰生股份   | 9,545,359.00 | 3.34 |
| 48 | 600172 | 黄河旋风   | 9,494,480.05 | 3.32 |
| 49 | 300329 | 海伦钢琴   | 9,304,553.58 | 3.26 |
| 50 | 002071 | 长城影视   | 9,222,410.05 | 3.23 |
| 51 | 300161 | 华中数控   | 9,033,917.86 | 3.16 |
| 52 | 002299 | 圣农发展   | 8,917,348.62 | 3.12 |
| 53 | 600108 | 亚盛集团   | 8,530,216.25 | 2.99 |
| 54 | 000078 | 海王生物   | 8,523,280.00 | 2.98 |
| 55 | 600055 | 华润万东   | 8,437,060.24 | 2.95 |
| 56 | 002667 | 鞍重股份   | 8,373,894.00 | 2.93 |
| 57 | 002089 | 新海宜    | 8,303,680.02 | 2.91 |
| 58 | 000802 | 北京文化   | 8,239,171.27 | 2.88 |
| 59 | 002701 | 奥瑞金    | 8,176,623.30 | 2.86 |
| 60 | 300203 | 聚光科技   | 8,147,225.48 | 2.85 |
| 61 | 600420 | 现代制药   | 8,111,165.00 | 2.84 |
| 62 | 300427 | 红相电力   | 8,045,192.00 | 2.82 |
| 63 | 601688 | 华泰证券   | 7,784,561.00 | 2.72 |
| 64 | 300232 | 洲明科技   | 7,751,495.00 | 2.71 |
| 65 | 600837 | 海通证券   | 7,729,888.60 | 2.71 |
| 66 | 300136 | 信维通信   | 7,640,328.00 | 2.67 |
| 67 | 002279 | 久其软件   | 7,598,371.37 | 2.66 |
| 68 | 002584 | 西陇科学   | 7,398,565.74 | 2.59 |
| 69 | 002450 | 康得新    | 7,247,096.82 | 2.54 |
| 70 | 002381 | 双箭股份   | 7,132,781.55 | 2.50 |
| 71 | 600478 | 科力远    | 6,971,429.97 | 2.44 |
| 72 | 600520 | 中发科技   | 6,834,891.93 | 2.39 |
| 73 | 002776 | 柏堡龙    | 6,812,555.05 | 2.38 |
| 74 | 002458 | 益生股份   | 6,790,471.00 | 2.38 |
| 75 | 002022 | 科华生物   | 6,761,542.44 | 2.37 |
| 76 | 000892 | *ST 星美 | 6,564,829.30 | 2.30 |
| 77 | 601012 | 隆基股份   | 6,509,342.62 | 2.28 |
| 78 | 000030 | 富奥股份   | 6,475,777.78 | 2.27 |
| 79 | 000700 | 模塑科技   | 6,473,185.50 | 2.27 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 80 | 300450 | 先导智能 | 6,468,516.50 | 2.26 |
| 81 | 300166 | 东方国信 | 6,455,143.72 | 2.26 |
| 82 | 603555 | 贵人鸟  | 6,427,209.71 | 2.25 |
| 83 | 000797 | 中国武夷 | 6,399,092.35 | 2.24 |
| 84 | 300098 | 高新兴  | 6,374,500.00 | 2.23 |
| 85 | 002117 | 东港股份 | 6,178,486.74 | 2.16 |
| 86 | 600815 | 厦工股份 | 6,125,113.28 | 2.14 |
| 87 | 600990 | 四创电子 | 6,087,980.00 | 2.13 |
| 88 | 600963 | 岳阳林纸 | 6,084,751.34 | 2.13 |
| 89 | 000411 | 英特集团 | 6,058,393.40 | 2.12 |
| 90 | 300282 | 汇冠股份 | 5,915,630.20 | 2.07 |
| 91 | 002547 | 春兴精工 | 5,871,558.00 | 2.06 |
| 92 | 600038 | 中直股份 | 5,866,366.20 | 2.05 |
| 93 | 002548 | 金新农  | 5,806,052.80 | 2.03 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,476,351,272.47 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,186,454,671.07 |

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。



**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

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

8.12.2 本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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 729,333.35 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 6,238.57   |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 735,571.92 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1  | 600122 | 宏图高科 | 11,685,014.00 | 4.09          | 重大事项     |

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 5,641        | 56,824.39     | 1,230,065.62 | 0.38%      | 319,316,341.17 | 99.62%     |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00       | 0.0000%  |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2015年7月8日) 基金份额总额 | 368,738,178.20 |
| 本报告期期初基金份额总额               | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 6,113,790.67   |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 54,305,562.08  |

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 320,546,406.79 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

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

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

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

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

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

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

#### 二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付的审计费用为 5 万元整，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 北京高华 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 长城证券 | 2      | 136,797,496.31 | 5.14%        | 127,398.43 | 5.24%      | -  |
| 川财证券 | 1      | 124,511,802.76 | 4.68%        | 113,469.51 | 4.67%      | -  |
| 第一创业 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 东北证券 | 2      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 东兴证券 | 1      | 165,825,897.95 | 6.23%        | 151,120.52 | 6.22%      | -  |
| 方正证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 光大证券 | 2      | 18,275,868.95  | 0.69%        | 16,654.76  | 0.69%      | -  |
| 广发证券 | 1      | -              | 0.00%        | -          | 0.00%      | -  |
| 国金证券 | 2      | 485,457,409.57 | 18.23%       | 442,541.57 | 18.21%     | -  |
| 国盛证券 | 1      | 44,478,265.15  | 1.67%        | 40,533.51  | 1.67%      | -  |
| 国泰君安 | 2      | 112,391,344.95 | 4.22%        | 102,037.51 | 4.20%      | -  |

|      |   |                |        |            |        |   |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 国信证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 海通证券 | 1 | 139,830,667.79 | 5.25%  | 127,429.02 | 5.24%  | - |
| 红塔证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 宏源证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 华创证券 | 1 | 152,858,493.79 | 5.74%  | 139,301.30 | 5.73%  | - |
| 华泰证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 华西证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 联讯证券 | 1 | 62,269,970.58  | 2.34%  | 56,747.74  | 2.33%  | - |
| 民生证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 南京证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 平安证券 | 1 | 23,686,948.03  | 0.89%  | 22,059.76  | 0.91%  | - |
| 齐鲁证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 瑞银证券 | 1 | 18,797,602.90  | 0.71%  | 17,506.15  | 0.72%  | - |
| 山西证券 | 1 | 107,594,339.83 | 4.04%  | 98,050.68  | 4.03%  | - |
| 上海证券 | 1 | 176,335,172.21 | 6.62%  | 164,219.72 | 6.76%  | - |
| 申银万国 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 世纪证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 天风证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 西部证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 湘财证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 兴业证券 | 2 | 100,008,779.48 | 3.76%  | 88,498.39  | 3.64%  | - |
| 银河证券 | 4 | 241,165,821.76 | 9.06%  | 218,213.49 | 8.98%  | - |
| 英大证券 | 1 | 53,857,411.45  | 2.02%  | 50,157.94  | 2.06%  | - |
| 招商证券 | 2 | 228,515,858.83 | 8.58%  | 208,939.52 | 8.60%  | - |
| 浙商证券 | 1 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 中金公司 | 2 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 中信建投 | 2 | 270,139,126.25 | 10.14% | 245,658.77 | 10.11% | - |
| 中信证券 | 2 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |
| 中银国际 | 2 | -              | 0.00%  | -          | 0.00%  | - |

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；

(四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；

(五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

本基金本报告期末所有席位均为本报告期内新增。本报告期内本基金退租席位：无。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

#### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司  
2016年3月26日