

大成灵活配置混合型证券投资基金  
2016 年半年度报告摘要  
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 大成灵活配置混合         |
| 基金主代码      | 000587           |
| 交易代码       | 000587           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2014 年 5 月 14 日  |
| 基金管理人      | 大成基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 186,737,265.26 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。  |
| 投资策略   | 本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 年化收益率 6%  |
| 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高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。   |

### 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           | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杜鹏                   | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 0755-83183388        | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4008885558           | 95566                |
| 传真      |      | 0755-83199588        | 010-66594942         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                          |
|----------------------|--------------------------|
| 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            |

## §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       | -14,065,231.86              |
| 本期利润          | -70,698,060.98              |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3510                     |
| 本期基金份额净值增长率   | -12.46%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4150                      |
| 期末基金资产净值      | 348,798,004.70              |
| 期末基金份额净值      | 1.868                       |

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。

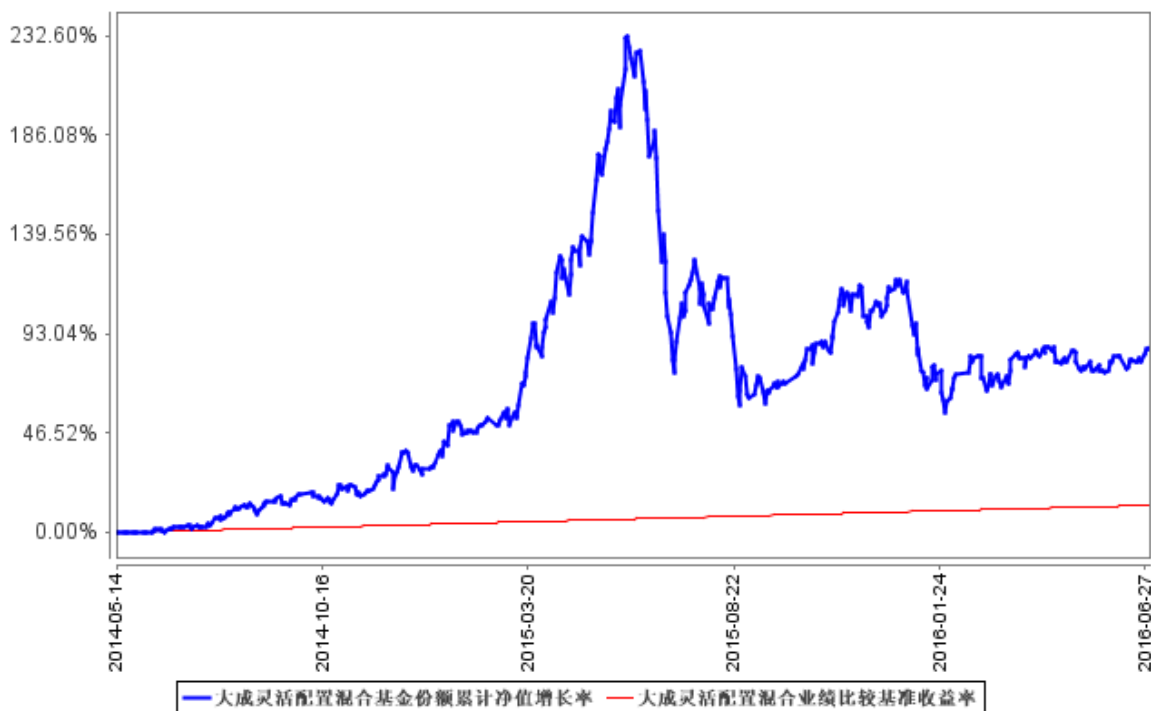
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 4.01%    | 1.06%       | 0.44%      | 0.02%         | 3.57%   | 1.04% |
| 过去三个月      | 2.30%    | 1.19%       | 1.34%      | 0.01%         | 0.96%   | 1.18% |
| 过去六个月      | -12.46%  | 2.09%       | 2.72%      | 0.02%         | -15.18% | 2.07% |
| 过去一年       | -22.13%  | 2.53%       | 5.63%      | 0.02%         | -27.76% | 2.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 86.80%   | 2.38%       | 12.80%     | 0.02%         | 74.00%  | 2.36% |

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## §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 |        |   |
| 孙蓓琳女士 | 本基金基金经理 | 2015 年 9 月 29 日 | -    | 12 年   | 经济学硕士。2004 年 7 月至 2007 年 7 月就职于银华基金管理有限公司，历任宏观研究员、行业研 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>究员。2007 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部副总监。2012 年 7 月 28 日至 2014 年 1 月 29 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012 年 12 月 18 日至 2015 年 7 月 2 日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 3 日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理，2015 年 9 月 29 日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部混合组投资总监。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

上半年市场波动巨大，开年第一天市场熔断导致新一轮股灾开始，基金在第一个月净值跌幅较大，去年组合中的传媒板块配置比例较高，对净值影响较大，2 季度开始对组合进行了适当调整，降低了组合整体的估值水平，增加了食品饮料板块的配置，在 2 季度中净值反弹，减少了今年以来的亏损。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.868 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.46%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%，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

展望下半年的市场，我们年初最为担心的通货膨胀压力已经缓解，国债收益率重新进入下降通道，我们认为整体市场避险情绪还在加重，市场没有增量资金入场，存量博弈持续。在这种市场环境，对公司质地的要求会增加，业绩好转、公司治理结构优秀、估值合理的个股依然是下一个阶段市场的主要方向。我们将加强研究覆盖，精选个股，为持有人创造更大价值。



#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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：大成灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|------------|-------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |                   |                     |
| 银行存款       | 54,138,585.72     | 76,706,862.76       |
| 结算备付金      | 511,936.88        | 2,403,603.50        |
| 存出保证金      | 231,027.63        | 836,742.02          |
| 交易性金融资产    | 292,898,879.19    | 389,919,086.29      |
| 其中：股票投资    | 292,542,025.59    | 389,471,966.29      |
| 基金投资       | -                 | -                   |
| 债券投资       | 356,853.60        | 447,120.00          |
| 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         | 6,549,770.21           | 9,557,228.31            |
| 应收利息            | 14,021.36              | 11,957.20               |
| 应收股利            | -                      | -                       |
| 应收申购款           | 74,085.87              | 124,120.82              |
| 递延所得税资产         | -                      | -                       |
| 其他资产            | -                      | -                       |
| 资产总计            | 354,418,306.86         | 479,559,600.90          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>             |
|                 | <b>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                        |                         |
| 短期借款            | -                      | -                       |
| 交易性金融负债         | -                      | -                       |
| 衍生金融负债          | -                      | -                       |
| 卖出回购金融资产款       | -                      | -                       |
| 应付证券清算款         | 3,480,769.53           | 11,837,467.95           |
| 应付赎回款           | 1,051,617.94           | 869,704.12              |
| 应付管理人报酬         | 419,375.38             | 580,040.73              |
| 应付托管费           | 69,895.90              | 96,673.44               |
| 应付销售服务费         | -                      | -                       |
| 应付交易费用          | 352,590.33             | 928,140.74              |
| 应交税费            | -                      | -                       |
| 应付利息            | -                      | -                       |
| 应付利润            | -                      | -                       |
| 递延所得税负债         | -                      | -                       |
| 其他负债            | 246,053.08             | 166,883.27              |
| 负债合计            | 5,620,302.16           | 14,478,910.25           |
| <b>所有者权益:</b>   |                        |                         |
| 实收基金            | 186,737,265.26         | 217,987,990.63          |
| 未分配利润           | 162,060,739.44         | 247,092,700.02          |
| 所有者权益合计         | 348,798,004.70         | 465,080,690.65          |
| 负债和所有者权益总计      | 354,418,306.86         | 479,559,600.90          |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，本基金的单位净值为 1.868 元，基金份额总额 186,737,265.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------|--|---|
| 一、收入 | -66,026,578.60                           | 243,057,380.99                                |

|                            |                       |                       |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1.利息收入                     | 326,110.88            | 440,360.06            |
| 其中：存款利息收入                  | 324,825.53            | 440,240.27            |
| 债券利息收入                     | 1,285.35              | 119.79                |
| 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）           | -10,504,572.03        | 234,747,804.70        |
| 其中：股票投资收益                  | -12,051,908.81        | 233,473,470.36        |
| 基金投资收益                     | -                     | -                     |
| 债券投资收益                     | -                     | 356,723.71            |
| 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                       | 1,547,336.78          | 917,610.63            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -56,632,829.12        | -2,285,130.72         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                     | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 784,711.67            | 10,154,346.95         |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>4,671,482.38</b>   | <b>15,488,886.76</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 2,684,973.36          | 5,203,040.80          |
| 2. 托管费                     | 447,495.54            | 867,173.46            |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 1,361,689.25          | 9,225,981.22          |
| 5. 利息支出                    | -                     | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     | -                     |
| 6. 其他费用                    | 177,324.23            | 192,691.28            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-70,698,060.98</b> | <b>227,568,494.23</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-70,698,060.98</b> | <b>227,568,494.23</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成灵活配置混合型证券投资基金

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<br>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<br>(基金净值) | 217,987,990.63                        | 247,092,700.02 | 465,080,690.65 |

|  |  |                   |                   |
|--|--|-------------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -70,698,060.98    | -70,698,060.98    |
| 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）      | -31,250,725.37                             | -14,333,899.60    | -45,584,624.97    |
| 其中：1.基金申购款                             | 63,064,239.76                              | 50,423,652.58     | 113,487,892.34    |
| 2.基金赎回款                                | -94,314,965.13                             | -64,757,552.18    | -159,072,517.31   |
| 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）                        | 186,737,265.26                             | 162,060,739.44    | 348,798,004.70    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 243,523,956.76                             | 72,936,497.59     | 316,460,454.35    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 227,568,494.23    | 227,568,494.23    |
| 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）      | 114,083,759.74                             | 199,874,595.29    | 313,958,355.03    |
| 其中：1.基金申购款                             | 937,164,072.87                             | 1,273,329,943.81  | 2,210,494,016.68  |
| 2.基金赎回款                                | -823,080,313.13                            | -1,073,455,348.52 | -1,896,535,661.65 |
| 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）                        | 357,607,716.50                             | 500,379,587.11    | 857,987,303.61    |

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 关联方关系

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构        |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)     | 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。

#### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未发生关联方交易。

##### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 光大证券  | -                          | -                | 461,897,770.09                  | 7.41%            |

###### 6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                |          |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总<br>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  | 420,509.91                      | 7.56%          | -        | 0.00%            |

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

等。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 2,684,973.36                   | 5,203,040.80                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,055,831.03                   | 1,382,509.06                    |

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。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 447,495.54                 | 867,173.46                      |

注：支付基金托管人中国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。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

##### 6.4.4.4.2 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除基金管理人之外的其他各关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.4.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月<br>30 日 |               | 上年度可比期间<br>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        |
|       | 中国银行                                     | 54,138,585.72 | 315,171.10                                 | 91,054,919.71 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

### 6.4.5 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.5.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                |        |       |        |              |           |           |    |
|---------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601966              | 玲珑轮胎 | 2016 年 6 月 24 日 | 2016 年 7 月 6 日 | 新股流通受限 | 12.98 | 12.98  | 2,739        | 35,552.22 | 35,552.22 | -  |
| 603016              | 新宏泰  | 2016 年 6 月 23 日 | 2016 年 7 月 1 日 | 新股流通受限 | 8.49  | 8.49   | 1,602        | 13,600.98 | 13,600.98 | -  |
| 300520              | 科大国创 | 2016 年 6 月 30 日 | 2016 年 7 月 8 日 | 新股流通受限 | 10.05 | 10.05  | 926          | 9,306.30  | 9,306.30  | -  |
| 002805              | 丰元股份 | 2016 年 6 月 29 日 | 2016 年 7 月 7 日 | 新股流通受限 | 5.80  | 5.80   | 971          | 5,631.80  | 5,631.80  | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.5.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 000835 | 长城动漫 | 2016年2月29日 | 重大资产重组 | 14.15  | 2016年7月22日 | 14.54  | 802,532 | 11,243,152.15 | 11,355,827.80 | -  |
| 002672 | 东江环保 | 2016年5月23日 | 重大事项   | 17.33  | 2016年7月15日 | 19.06  | 620,800 | 10,221,874.75 | 10,758,464.00 | -  |
| 002567 | 唐人神  | 2016年5月16日 | 重大事项   | 13.98  | 2016年7月29日 | 13.23  | 435,100 | 5,733,772.48  | 6,082,698.00  | -  |

注：本基金截至 2016 年 6 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。

#### 6.4.5.3 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。

## §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              | 292,542,025.59 | 82.54         |
|    | 其中：股票             | 292,542,025.59 | 82.54         |
| 2  | 固定收益投资            | 356,853.60     | 0.10          |
|    | 其中：债券             | 356,853.60     | 0.10          |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 54,650,522.60  | 15.42         |
| 7  | 其他各项资产            | 6,868,905.07   | 1.94          |
| 8  | 合计                | 354,418,306.86 | 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         | 9,446,128.73   | 2.71         |
| B  | 采矿业              | 3,537,779.30   | 1.01         |
| C  | 制造业              | 182,934,145.58 | 52.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 168,761.64     | 0.05         |
| F  | 批发和零售业           | 56,032,247.99  | 16.06        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 18,485,380.25  | 5.30         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 20,126.10      | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 10,758,464.00  | 3.08         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 11,158,992.00  | 3.20         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 292,542,025.59 | 83.87        |

### 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  | 600887 | 伊利股份 | 1,304,600 | 21,747,682.00 | 6.24 |
| 2  | 000963 | 华东医药 | 309,448   | 20,856,795.20 | 5.98 |
| 3  | 000078 | 海王生物 | 2,292,753 | 17,035,154.79 | 4.88 |
| 4  | 000892 | 星美联合 | 1,058,879 | 14,983,137.85 | 4.30 |
| 5  | 002640 | 跨境通  | 846,000   | 14,906,520.00 | 4.27 |
| 6  | 600867 | 通化东宝 | 702,120   | 14,526,862.80 | 4.16 |
| 7  | 000835 | 长城动漫 | 802,532   | 11,355,827.80 | 3.26 |
| 8  | 300072 | 三聚环保 | 405,872   | 11,218,302.08 | 3.22 |
| 9  | 300364 | 中文在线 | 214,596   | 11,158,992.00 | 3.20 |
| 10 | 002672 | 东江环保 | 620,800   | 10,758,464.00 | 3.08 |

注：投资者欲了解本报告期末基金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.dcfund.com.cn>）的半年度报告正文。

#### 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  | 600887 | 伊利股份 | 20,274,799.00 | 4.36           |
| 2  | 600547 | 山东黄金 | 20,026,824.14 | 4.31           |
| 3  | 000892 | 星美联合 | 16,710,567.10 | 3.59           |
| 4  | 000963 | 华东医药 | 15,854,548.20 | 3.41           |
| 5  | 002640 | 跨境通  | 15,736,068.25 | 3.38           |
| 6  | 601069 | 西部黄金 | 12,618,061.25 | 2.71           |
| 7  | 000625 | 长安汽车 | 12,521,219.24 | 2.69           |
| 8  | 000060 | 中金岭南 | 12,302,085.77 | 2.65           |
| 9  | 002157 | 正邦科技 | 11,904,900.30 | 2.56           |
| 10 | 002235 | 安妮股份 | 11,740,800.00 | 2.52           |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 11,588,072.25 | 2.49           |
| 12 | 300072 | 三聚环保 | 10,923,238.52 | 2.35           |
| 13 | 002601 | 佰利联  | 10,488,660.58 | 2.26           |
| 14 | 002672 | 东江环保 | 10,221,874.75 | 2.20           |
| 15 | 300364 | 中文在线 | 10,173,611.40 | 2.19           |
| 16 | 300056 | 三维丝  | 9,751,262.50  | 2.10           |
| 17 | 600110 | 诺德股份 | 9,661,761.12  | 2.08           |
| 18 | 600259 | 广晟有色 | 8,903,589.36  | 1.91           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 600489 | 中金黄金 | 8,473,194.50 | 1.82 |
| 20 | 002675 | 东诚药业 | 7,556,524.32 | 1.62 |

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。

#### 7.4.2 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  | 600682 | 南京新百 | 60,239,071.19 | 12.95          |
| 2  | 002517 | 恺英网络 | 24,686,262.49 | 5.31           |
| 3  | 600547 | 山东黄金 | 24,558,180.41 | 5.28           |
| 4  | 000892 | 星美联合 | 21,453,902.02 | 4.61           |
| 5  | 002355 | 兴民钢圈 | 18,614,115.59 | 4.00           |
| 6  | 300395 | 菲利华  | 15,602,476.02 | 3.35           |
| 7  | 000802 | 北京文化 | 13,448,426.42 | 2.89           |
| 8  | 601069 | 西部黄金 | 12,923,698.27 | 2.78           |
| 9  | 002601 | 佰利联  | 12,891,676.04 | 2.77           |
| 10 | 002235 | 安妮股份 | 11,675,562.44 | 2.51           |
| 11 | 603555 | 贵人鸟  | 10,623,362.38 | 2.28           |
| 12 | 000963 | 华东医药 | 9,970,542.73  | 2.14           |
| 13 | 600136 | 当代明诚 | 9,041,126.23  | 1.94           |
| 14 | 600259 | 广晟有色 | 9,026,328.50  | 1.94           |
| 15 | 600489 | 中金黄金 | 8,665,815.03  | 1.86           |
| 16 | 002175 | 东方网络 | 8,433,240.56  | 1.81           |
| 17 | 300467 | 迅游科技 | 7,966,506.39  | 1.71           |
| 18 | 002157 | 正邦科技 | 7,963,601.76  | 1.71           |
| 19 | 600777 | 新潮能源 | 7,539,738.30  | 1.62           |
| 20 | 002137 | 麦达数字 | 7,453,126.00  | 1.60           |

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 | 435,248,891.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 463,584,360.98 |

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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 4  | 企业债券      | -          | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -            |
| 6  | 中期票据      | -          | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 356,853.60 | 0.10         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 356,853.60 | 0.10         |

**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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张） | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 132003 | 15 清控 EB | 3,240 | 356,853.60 | 0.10         |

**7.7 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。

**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。

**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。

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 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   | 231,027.63   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,549,770.21 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 14,021.36    |
| 5  | 应收申购款   | 74,085.87    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 6,868,905.07 |

**7.12.2 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。

**7.12.3 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  | 000835 | 长城动漫 | 11,355,827.80 | 3.26         | 重大资产重组   |
| 2  | 002672 | 东江环保 | 10,758,464.00 | 3.08         | 重大事项     |

**7.12.4 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<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 |
| 13,404       | 13,931.46     | 2,447,300.96 | 1.31%      | 184,289,964.30 | 98.69%     |

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<br>持有本基金 | 93,217.48 | 0.0499%  |

### 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<br>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5月14日）基金份额总额 | 231,384,879.44 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 217,987,990.63 |
| 本报告期基金总申购份额               | 63,064,239.76  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 94,314,965.13  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -              |
| 本报告期末基金份额总额               | 186,737,265.26 |



## §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

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，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 |    |
|      |        |      |              |           |            |    |

|      |   |                |        |            |        |    |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|----|
| 中金公司 | 2 | 190,882,332.12 | 21.26% | 174,018.12 | 21.26% | -  |
| 安信证券 | 2 | 167,132,910.03 | 18.62% | 152,500.92 | 18.63% | -  |
| 国信证券 | 1 | 165,855,915.79 | 18.47% | 151,148.80 | 18.47% | -  |
| 招商证券 | 2 | 79,902,992.43  | 8.90%  | 72,819.19  | 8.90%  | -  |
| 华鑫证券 | 1 | 63,042,279.92  | 7.02%  | 57,450.94  | 7.02%  | -  |
| 华泰证券 | 2 | 52,188,316.75  | 5.81%  | 47,558.65  | 5.81%  | -  |
| 东方证券 | 1 | 44,235,924.01  | 4.93%  | 40,311.26  | 4.93%  | -  |
| 西南证券 | 1 | 40,398,217.02  | 4.50%  | 36,813.89  | 4.50%  | -  |
| 华宝证券 | 1 | 27,770,763.53  | 3.09%  | 25,308.84  | 3.09%  | -  |
| 广州证券 | 1 | 26,147,172.81  | 2.91%  | 23,826.19  | 2.91%  | -  |
| 东吴证券 | 1 | 24,801,306.65  | 2.76%  | 22,602.22  | 2.76%  | -  |
| 湘财证券 | 1 | 9,077,887.00   | 1.01%  | 8,272.77   | 1.01%  | -  |
| 江海证券 | 1 | 6,386,565.00   | 0.71%  | 5,819.74   | 0.71%  | -  |
| 民生证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 民族证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 平安证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | 新增 |
| 申银万国 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 天源证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 万联证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 东兴证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 方正证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | 新增 |
| 广发证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 东海证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 东莞证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 财富证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 长城证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 英大证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 中航证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 中银国际 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 国都证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 国海证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 国泰君安 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 恒泰证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | 新增 |
| 华福证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 华林证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 渤海证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | -  |
| 海通证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 3 | - | - | - | - | - |

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：恒泰证券、方正证券、平安证券。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。

### §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。

大成基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日