

大成健康产业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。

大成健康产业股票型证券投资基金基金合同已于 2014 年 1 月 24 日生效。自基金合同生效以来，本基金运作平稳。根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）的有关规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 22 日起本基金名称变更为“大成健康产业混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成健康产业混合”；基金类别变更为“混合型”。基金代码保持不变，仍为 090020。上述事项已报中国证监会备案。因上述变更基金名称及基金类别事宜，基金管理人就《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了相应修改。在修改过程中，基金管理人根据《运作办法》和基金运作实际情况，对《基金合同》的部分条款进行了必要的调整。就前述修改变更事项，基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

按照基金合同约定，本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形，不需要召开基金份额持有人大会。本基金更名后，《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》、《大成健康产业股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成健康产业混合型证券投资基金承担和继承。

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 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。

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

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成健康产业混合
基金主代码	090020
交易代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 28 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	37,604,250.04 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。 为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易场所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

注：根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康

产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

## 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	010-66594896

## 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	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国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	2014 年	2013 年
本期已实现收益	769,391.42	-2,196,186.92	3,613,627.62
本期利润	7,832,978.02	-3,524,264.17	4,869,984.64
加权平均基金份额本期利润	0.2051	-0.0644	0.1245
本期基金份额净值增长率	26.81%	-7.01%	6.14%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1608	-0.0191	0.0545
期末基金资产净值	46,762,223.82	35,373,079.73	54,349,333.21
期末基金份额净值	1.244	0.981	1.055

注：1. 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。

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）。

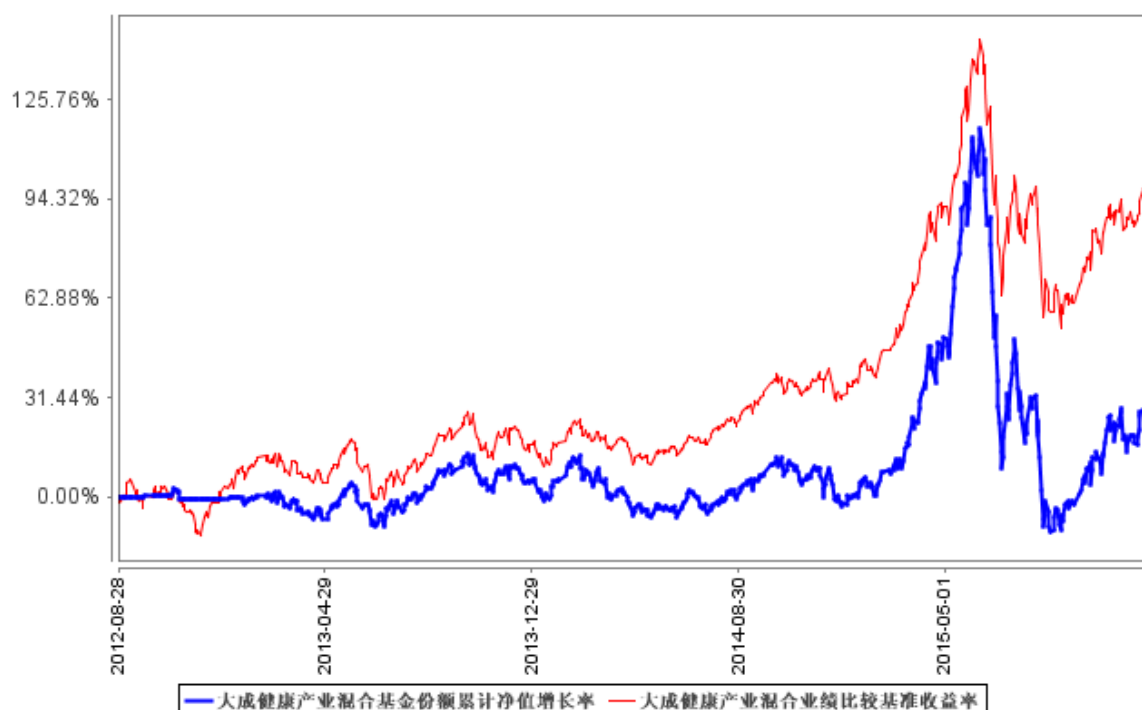
### 3.2 基金净值表现

#### 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	27.72%	2.44%	20.57%	1.56%	7.15%	0.88%
过去六个月	-21.07%	3.57%	-3.43%	2.40%	-17.64%	1.17%
过去一年	26.81%	3.14%	47.52%	2.14%	-20.71%	1.00%
过去三年	25.15%	2.06%	88.90%	1.57%	-63.75%	0.49%
自基金合同生效起至今	24.40%	1.96%	94.83%	1.55%	-70.43%	0.41%

注：根据《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

#### 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



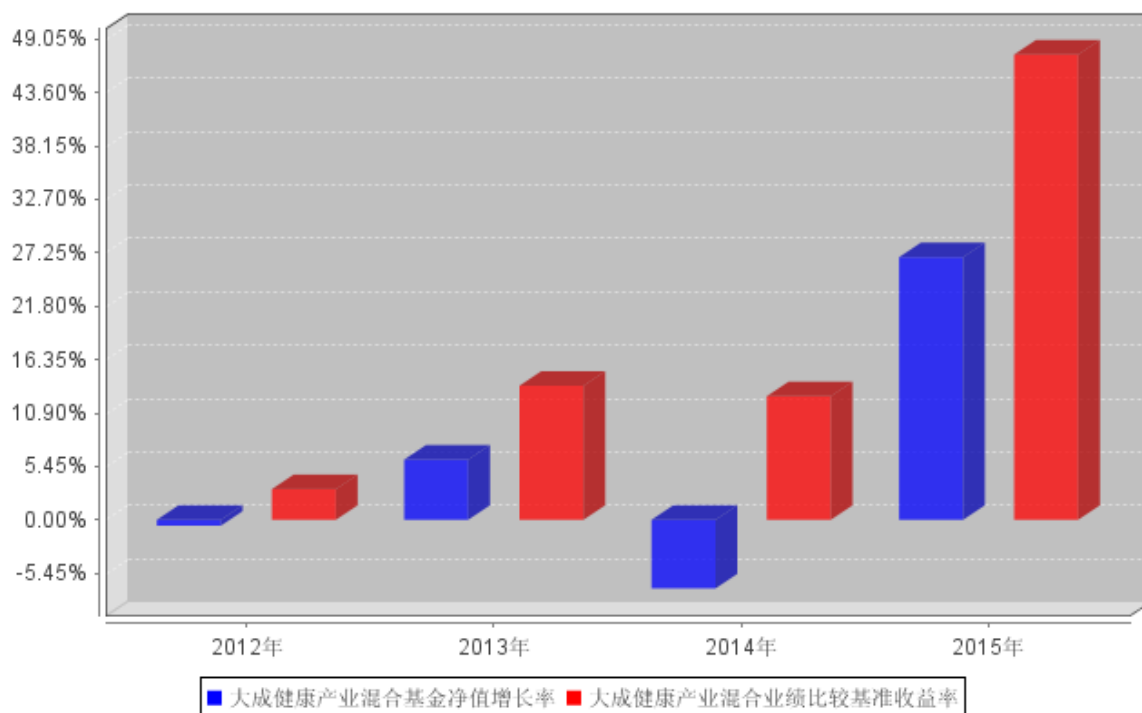
注：1、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，

修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日(基金合同生效日)起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3、根据《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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：2012 年净值增长率表现期间为 2012 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2012 年 8 月 28 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	2014年6月26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》、《大成健康产业混



《大成健康产业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，大成健康产业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）。

2015 年上半年的策略和运作情况在中报中已经有详述，在此仅简要描述一下：2015 年春节后我们明确了对市场的认识后坚定看多获得了非常不错的投资回报，但是在六月由于对本轮回调可能产生的幅度估计不足，没有做好足够的措施，导致损失前期浮盈被大幅度消耗，是上半年最大败笔。

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 6 月后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，是今年最大败笔，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 1.244 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.81%，同期业绩比较基准收益率为 47.52%，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“保增长”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 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 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 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，但资产负增长会对宏观经济造成严重冲击，这可能需要与“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 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的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。本报告期末本基金无可供分配收益。

#### 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

本基金在本报告期内，曾于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

### § 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”）在对大成健康产业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 审计报告

本基金 2015 年年度财务报告已经安永华明会计师事务所（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：大成健康产业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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,891,279.65	5,861,249.64
结算备付金	568,077.57	135,748.05
存出保证金	69,376.57	31,174.87
交易性金融资产	42,227,368.00	29,417,825.78
其中：股票投资	42,227,368.00	29,417,825.78
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	1,442,476.32	1,014,621.71
应收利息	1,026.77	1,067.89
应收股利	-	-
应收申购款	19,309.69	75,684.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	47,218,914.57	36,537,372.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	536,415.09
应付赎回款	63,089.68	96,507.69
应付管理人报酬	62,059.30	49,185.43
应付托管费	10,343.22	8,197.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	240,960.79	143,659.44
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,237.76	330,327.45
负债合计	456,690.75	1,164,292.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	37,604,250.04	36,061,686.85
未分配利润	9,157,973.78	-688,607.12
所有者权益合计	46,762,223.82	35,373,079.73
负债和所有者权益总计	47,218,914.57	36,537,372.38

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.244 元，基金份额总额

37,604,250.04 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	10,422,541.20	-826,699.75
1. 利息收入	53,938.59	64,082.05
其中：存款利息收入	53,938.59	64,082.05
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）	3,066,373.81	293,498.66
其中：股票投资收益	2,933,086.92	-1,862,361.56
基金投资收益	-	1,857,349.56
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	133,286.89	298,510.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,063,586.60	-1,328,077.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	238,642.20	143,796.79
<b>减：二、费用</b>	2,589,563.18	2,697,564.42

1. 管理人报酬	731,912.96	782,076.80
2. 托管费	121,985.53	130,384.11
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,527,838.46	1,395,076.57
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	207,826.23	390,026.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,832,978.02	-3,524,264.17
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,832,978.02	-3,524,264.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,061,686.85	-688,607.12	35,373,079.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,832,978.02	7,832,978.02
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）	1,542,563.19	2,013,602.88	3,556,166.07
其中：1. 基金申购款	146,106,349.71	56,295,676.46	202,402,026.17
2. 基金赎回款	-144,563,786.52	-54,282,073.58	-198,845,860.10
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）	37,604,250.04	9,157,973.78	46,762,223.82
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		



	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	51,540,055.08	2,809,278.13	54,349,333.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,524,264.17	-3,524,264.17
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）	-15,478,368.23	26,378.92	-15,451,989.31
其中：1. 基金申购款	96,689,473.12	6,099,549.62	102,789,022.74
2. 基金赎回款	-112,167,841.35	-6,073,170.70	-118,241,012.05
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）	36,061,686.85	-688,607.12	35,373,079.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

周立新

范瑛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 税项

#### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳；

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

#### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

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

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

#### 7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.3 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、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、基金代销机构
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、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司（“广东证券”）	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：(1) 于本报告期，无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况  
 (2) 中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。  
 (3) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	43,788,833.21	4.31%	44,752,389.42	4.87%

###### 7.4.4.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.4.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.4.1.4 回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

###### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	39,906.80	4.35%	39,906.80	16.56%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	39,660.31	4.83%	-	0.00%

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

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

息服务等。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	731,912.96	782,076.80
其中：支付销售机构的客户维护费	240,509.44	294,772.69

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

（2）于 2015 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 62,059.30 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 49,185.43 元）。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,985.53	130,384.11

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）于 2015 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 10,343.22 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 8,197.55 元）。

**7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.36%	13.93%

**7.4.4.4.2 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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

**7.4.4.5 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 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,891,279.65	46,578.62	5,861,249.64	57,378.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.5 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

## 7.4.5.2 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
600682	南京新百	2015年7月1日	重大事项停牌	32.97	2016年1月 27日	33.78	93,200	1,033,880.00	3,072,804.00	-
600122	宏图高科	2015年12月25日	重大事项停牌	19.42	-	-	79,300	1,440,906.71	1,540,006.00	-
600584	长电科技	2015年11月30日	重大事项停牌	22.02	-	-	54,800	1,096,000.00	1,206,696.00	-

## 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 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	42,227,368.00	89.43
	其中：股票	42,227,368.00	89.43
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	3,459,357.22	7.33
7	其他各项资产	1,532,189.35	3.24
8	合计	47,218,914.57	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	24,879,145.00	53.20
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	11,561,829.00	24.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,930,922.00	10.54
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	855,472.00	1.83
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	42,227,368.00	90.30

## 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	300078	思创医惠	85,150	4,155,320.00	8.89
2	002355	兴民钢圈	186,000	3,731,160.00	7.98

3	000078	海王生物	137,300	3,289,708.00	7.03
4	600682	南京新百	93,200	3,072,804.00	6.57
5	300109	新开源	25,500	2,653,275.00	5.67
6	002019	亿帆鑫富	63,342	2,533,680.00	5.42
7	000952	广济药业	92,300	2,122,900.00	4.54
8	600079	人福医药	88,100	1,961,106.00	4.19
9	000516	国际医学	83,300	1,832,600.00	3.92
10	603883	老百姓	25,300	1,795,541.00	3.84

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	000722	湖南发展	13,584,242.12	38.40
2	000078	海王生物	11,088,361.00	31.35
3	002019	亿帆鑫富	9,662,565.42	27.32
4	600518	康美药业	9,528,605.70	26.94
5	000910	大亚科技	8,611,146.00	24.34
6	300255	常山药业	8,462,919.92	23.92
7	300199	翰宇药业	8,069,959.32	22.81
8	002366	台海核电	7,299,263.92	20.64
9	300147	香雪制药	7,077,656.00	20.01
10	300273	和佳股份	6,908,261.60	19.53
11	002572	索菲亚	6,502,239.50	18.38
12	300168	万达信息	6,154,512.00	17.40
13	300146	汤臣倍健	5,751,605.81	16.26
14	300244	迪安诊断	5,482,869.89	15.50
15	600750	江中药业	5,374,984.99	15.20
16	300078	思创医惠	5,227,822.00	14.78
17	600511	国药股份	5,166,622.65	14.61
18	000516	国际医学	5,118,182.00	14.47
19	600572	康恩贝	4,975,036.48	14.06



20	300109	新开源	4,919,331.00	13.91
21	002584	西陇科学	4,839,295.93	13.68
22	000802	北京文化	4,803,378.59	13.58
23	002251	步步高	4,763,594.92	13.47
24	002422	科伦药业	4,620,210.46	13.06
25	000028	国药一致	4,586,873.96	12.97
26	002433	太安堂	4,582,935.52	12.96
27	600038	中直股份	4,229,583.21	11.96
28	600055	华润万东	4,091,348.17	11.57
29	600079	人福医药	3,973,391.15	11.23
30	002169	智光电气	3,962,002.00	11.20
31	300464	星徽精密	3,959,270.00	11.19
32	600998	九州通	3,855,469.68	10.90
33	600280	中央商场	3,675,874.00	10.39
34	000411	英特集团	3,605,018.02	10.19
35	000938	紫光股份	3,551,108.00	10.04
36	300098	高新兴	3,547,181.60	10.03
37	600420	现代制药	3,498,319.10	9.89
38	300049	福瑞股份	3,447,696.59	9.75
39	002312	三泰控股	3,432,036.75	9.70
40	000566	海南海药	3,408,626.20	9.64
41	300331	苏大维格	3,396,156.00	9.60
42	002462	嘉事堂	3,395,200.35	9.60
43	002044	美年健康	3,302,583.68	9.34
44	002355	兴民钢圈	3,290,477.00	9.30
45	002547	春兴精工	3,265,134.79	9.23
46	600521	华海药业	3,226,948.72	9.12
47	600873	梅花生物	3,146,983.45	8.90
48	002517	泰亚股份	3,145,608.10	8.89
49	000926	福星股份	3,091,099.30	8.74
50	000796	凯撒旅游	3,069,031.00	8.68
51	600332	白云山	3,034,592.00	8.58
52	300144	宋城演艺	2,899,484.00	8.20
53	600276	恒瑞医药	2,895,600.00	8.19
54	600867	通化东宝	2,848,279.40	8.05
55	002468	艾迪西	2,814,500.87	7.96

56	002086	东方海洋	2,743,799.98	7.76
57	002085	万丰奥威	2,734,125.60	7.73
58	300009	安科生物	2,723,301.67	7.70
59	600713	南京医药	2,653,276.00	7.50
60	000963	华东医药	2,596,391.42	7.34
61	300253	卫宁健康	2,581,471.00	7.30
62	300015	爱尔眼科	2,557,515.00	7.23
63	002009	天奇股份	2,545,337.00	7.20
64	002235	安妮股份	2,535,640.00	7.17
65	002313	日海通讯	2,534,549.00	7.17
66	002614	蒙发利	2,493,283.50	7.05
67	002651	利君股份	2,436,791.68	6.89
68	002175	东方网络	2,376,694.00	6.72
69	600520	中发科技	2,359,188.96	6.67
70	300064	豫金刚石	2,348,666.00	6.64
71	600535	天士力	2,340,619.00	6.62
72	002183	怡亚通	2,328,669.00	6.58
73	600172	黄河旋风	2,198,440.06	6.22
74	600217	*ST 秦岭	2,187,489.00	6.18
75	000952	广济药业	2,176,330.00	6.15
76	000100	TCL 集团	2,162,335.00	6.11
77	002071	长城影视	2,114,245.00	5.98
78	300341	麦迪电气	2,114,072.00	5.98
79	002117	东港股份	2,042,851.32	5.78
80	600358	国旅联合	2,039,685.58	5.77
81	300161	华中数控	1,991,490.00	5.63
82	300299	富春通信	1,990,823.50	5.63
83	600303	曙光股份	1,968,368.00	5.56
84	300205	天喻信息	1,945,477.00	5.50
85	600017	日照港	1,935,894.00	5.47
86	002113	天润控股	1,935,073.94	5.47
87	002234	民和股份	1,891,456.00	5.35
88	300017	网宿科技	1,872,056.80	5.29
89	603883	老百姓	1,860,824.20	5.26
90	300284	苏交科	1,846,487.00	5.22
91	300395	菲利华	1,837,443.00	5.19

92	002317	众生药业	1,768,776.00	5.00
93	000810	创维数字	1,766,832.92	4.99
94	002421	达实智能	1,766,131.40	4.99
95	601318	中国平安	1,757,653.00	4.97
96	000576	广东甘化	1,748,368.00	4.94
97	600718	东软集团	1,717,911.83	4.86
98	300427	红相电力	1,706,038.00	4.82
99	000710	天兴仪表	1,692,225.00	4.78
100	600571	信雅达	1,688,035.00	4.77
101	002605	姚记扑克	1,671,054.06	4.72
102	300075	数字政通	1,659,424.00	4.69
103	300432	富临精工	1,657,424.00	4.69
104	300390	天华超净	1,656,959.00	4.68
105	600337	美克家居	1,630,243.50	4.61
106	300096	易联众	1,591,050.95	4.50
107	603555	贵人鸟	1,583,849.00	4.48
108	002599	盛通股份	1,579,964.00	4.47
109	000705	浙江震元	1,571,721.00	4.44
110	300364	中文在线	1,568,305.00	4.43
111	000650	仁和药业	1,560,508.00	4.41
112	002642	荣之联	1,542,084.00	4.36
113	300136	信维通信	1,540,399.51	4.35
114	000503	海虹控股	1,533,927.50	4.34
115	300251	光线传媒	1,527,713.80	4.32
116	300250	初灵信息	1,518,663.04	4.29
117	300166	东方国信	1,488,768.85	4.21
118	002259	升达林业	1,479,969.00	4.18
119	002279	久其软件	1,472,715.00	4.16
120	002299	圣农发展	1,471,204.80	4.16
121	002467	二六三	1,441,091.00	4.07
122	600122	宏图高科	1,440,906.71	4.07
123	000892	*ST 星美	1,439,285.00	4.07
124	300178	腾邦国际	1,433,578.00	4.05
125	002390	信邦制药	1,426,013.00	4.03
126	002730	电光科技	1,418,454.00	4.01
127	002667	鞍重股份	1,410,047.00	3.99

128	600282	南钢股份	1,400,472.00	3.96
129	002226	江南化工	1,390,374.00	3.93
130	300396	迪瑞医疗	1,385,998.50	3.92
131	600826	兰生股份	1,383,985.00	3.91
132	000592	平潭发展	1,367,196.00	3.87
133	600581	八一钢铁	1,337,238.00	3.78
134	000829	天音控股	1,330,700.00	3.76
135	600645	中源协和	1,330,371.00	3.76
136	000538	云南白药	1,314,500.00	3.72
137	002089	新海宜	1,287,644.00	3.64
138	002030	达安基因	1,285,180.00	3.63
139	002429	兆驰股份	1,269,898.97	3.59
140	002583	海能达	1,252,062.90	3.54
141	300450	先导智能	1,228,948.00	3.47
142	002055	得润电子	1,221,622.00	3.45
143	300203	聚光科技	1,192,120.00	3.37
144	300246	宝莱特	1,174,660.00	3.32
145	600211	西藏药业	1,173,781.80	3.32
146	300019	硅宝科技	1,166,700.00	3.30
147	300247	乐金健康	1,165,000.00	3.29
148	300030	阳普医疗	1,157,527.00	3.27
149	300329	海伦钢琴	1,147,858.49	3.25
150	600815	厦工股份	1,140,754.75	3.22
151	002548	金新农	1,139,750.00	3.22
152	300135	宝利国际	1,138,500.00	3.22
153	300018	中元华电	1,134,606.00	3.21
154	000687	华讯方舟	1,125,646.00	3.18
155	002513	蓝丰生化	1,103,058.00	3.12
156	000700	模塑科技	1,100,213.00	3.11
157	002717	岭南园林	1,098,420.00	3.11
158	600584	长电科技	1,096,000.00	3.10
159	600080	金花股份	1,094,576.00	3.09
160	002354	天神娱乐	1,084,800.00	3.07
161	002022	科华生物	1,070,128.00	3.03
162	002450	康得新	1,059,096.08	2.99
163	603885	吉祥航空	1,055,710.00	2.98

164	300353	东土科技	1,048,335.80	2.96
165	000555	神州信息	1,034,276.04	2.92
166	600682	南京新百	1,033,880.00	2.92
167	002458	益生股份	1,025,676.00	2.90
168	000513	丽珠集团	1,023,400.00	2.89
169	000961	中南建设	1,020,877.00	2.89
170	000797	中国武夷	1,014,747.00	2.87
171	600343	航天动力	1,002,770.00	2.83
172	300209	天泽信息	998,457.00	2.82
173	600146	大元股份	995,150.00	2.81
174	002363	隆基机械	993,565.00	2.81
175	600804	鹏博士	993,055.00	2.81
176	002294	信立泰	988,964.23	2.80
177	300113	顺网科技	979,200.00	2.77
178	300153	科泰电源	978,888.50	2.77
179	002157	正邦科技	947,524.01	2.68
180	002172	澳洋科技	946,755.00	2.68
181	300051	三五互联	942,718.00	2.67
182	000021	深科技	936,548.00	2.65
183	300162	雷曼股份	929,700.00	2.63
184	300239	东宝生物	883,406.00	2.50
185	002223	鱼跃医疗	879,186.00	2.49
186	300238	冠昊生物	876,049.00	2.48
187	300314	戴维医疗	875,978.00	2.48
188	002348	高乐股份	875,193.00	2.47
189	300369	绿盟科技	857,650.00	2.42
190	601628	中国人寿	855,560.00	2.42
191	601688	华泰证券	843,864.00	2.39
192	300282	汇冠股份	840,797.70	2.38
193	603678	火炬电子	840,781.00	2.38
194	002381	双箭股份	837,148.00	2.37
195	000590	*ST 古汉	834,855.00	2.36
196	603669	灵康药业	826,968.00	2.34
197	300275	梅安森	820,622.00	2.32
198	300294	博雅生物	815,277.00	2.30
199	002701	奥瑞金	815,265.00	2.30

200	600478	科力远	810,249.00	2.29
201	600598	北大荒	799,195.00	2.26
202	002776	柏堡龙	786,367.00	2.22
203	300204	舒泰神	784,633.40	2.22
204	300232	洲明科技	776,326.00	2.19
205	600108	亚盛集团	773,044.00	2.19
206	600222	太龙药业	771,122.35	2.18
207	603008	喜临门	765,370.00	2.16
208	002737	葵花药业	752,604.00	2.13
209	002229	鸿博股份	752,598.00	2.13
210	002568	百润股份	744,750.00	2.11
211	002020	京新药业	721,680.00	2.04

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	300255	常山药业	11,219,794.82	31.72
2	600518	康美药业	10,940,996.00	30.93
3	000722	湖南发展	10,752,546.04	30.40
4	000910	大亚科技	9,229,681.60	26.09
5	300199	翰宇药业	9,047,650.33	25.58
6	300273	和佳股份	8,632,360.10	24.40
7	300147	香雪制药	8,138,835.78	23.01
8	300168	万达信息	7,674,814.80	21.70
9	002366	台海核电	7,352,490.00	20.79
10	002572	索菲亚	7,157,978.20	20.24
11	000078	海王生物	6,923,683.90	19.57
12	002019	亿帆鑫富	6,601,271.57	18.66
13	300244	迪安诊断	6,401,895.69	18.10
14	002584	西陇科学	6,097,504.71	17.24
15	300146	汤臣倍健	5,977,612.00	16.90
16	600511	国药股份	5,734,310.00	16.21
17	002433	太安堂	5,570,484.22	15.75
18	600750	江中药业	5,382,229.85	15.22

19	002251	步步高	5,333,912.36	15.08
20	300049	福瑞股份	5,103,519.28	14.43
21	600572	康恩贝	5,054,354.14	14.29
22	002462	嘉事堂	4,880,270.58	13.80
23	000028	国药一致	4,827,352.28	13.65
24	002422	科伦药业	4,815,349.00	13.61
25	600998	九州通	4,612,090.10	13.04
26	600521	华海药业	4,580,391.13	12.95
27	600055	华润万东	4,421,992.71	12.50
28	300253	卫宁健康	4,330,627.90	12.24
29	000566	海南海药	4,205,804.00	11.89
30	000802	北京文化	4,132,606.71	11.68
31	300464	星徽精密	4,006,643.50	11.33
32	600420	现代制药	3,985,834.20	11.27
33	000938	紫光股份	3,981,305.00	11.26
34	000516	国际医学	3,863,325.52	10.92
35	600276	恒瑞医药	3,774,624.97	10.67
36	300331	苏大维格	3,642,082.00	10.30
37	002044	美年健康	3,624,526.80	10.25
38	002085	万丰奥威	3,619,233.44	10.23
39	600038	中直股份	3,611,139.74	10.21
40	000411	英特集团	3,573,180.02	10.10
41	300078	思创医惠	3,563,823.00	10.07
42	300015	爱尔眼科	3,183,506.85	9.00
43	000503	海虹控股	3,150,730.52	8.91
44	600867	通化东宝	3,091,534.97	8.74
45	600332	白云山	3,085,484.45	8.72
46	600873	梅花生物	3,071,001.62	8.68
47	300144	宋城演艺	3,014,814.00	8.52
48	300098	高新兴	2,982,596.64	8.43
49	002468	艾迪西	2,969,724.50	8.40
50	002086	东方海洋	2,964,755.00	8.38
51	000796	凯撒旅游	2,891,972.92	8.18
52	600713	南京医药	2,822,457.00	7.98
53	601318	中国平安	2,822,320.84	7.98
54	002517	泰亚股份	2,813,328.48	7.95
55	300233	金城医药	2,806,501.79	7.93
56	000963	华东医药	2,634,185.86	7.45

57	002235	安妮股份	2,530,421.40	7.15
58	300341	麦迪电气	2,516,973.00	7.12
59	002175	东方网络	2,503,153.75	7.08
60	600280	中央商场	2,489,857.00	7.04
61	002169	智光电气	2,437,069.56	6.89
62	600535	天士力	2,412,281.69	6.82
63	002009	天奇股份	2,392,634.00	6.76
64	300064	豫金刚石	2,389,468.10	6.76
65	300075	数字政通	2,379,193.26	6.73
66	300109	新开源	2,369,599.60	6.70
67	002547	春兴精工	2,365,354.39	6.69
68	002183	怡亚通	2,360,771.00	6.67
69	600079	人福医药	2,359,737.18	6.67
70	002614	蒙发利	2,326,322.08	6.58
71	002113	天润控股	2,230,974.58	6.31
72	600358	国旅联合	2,216,056.78	6.26
73	000705	浙江震元	2,196,216.00	6.21
74	000100	TCL 集团	2,195,977.00	6.21
75	300432	富临精工	2,191,288.00	6.19
76	002312	三泰控股	2,170,120.92	6.13
77	600172	黄河旋风	2,131,231.85	6.03
78	000650	仁和药业	2,078,477.17	5.88
79	000926	福星股份	2,058,462.81	5.82
80	002071	长城影视	1,985,991.10	5.61
81	300390	天华超净	1,949,572.00	5.51
82	002117	东港股份	1,931,144.52	5.46
83	300009	安科生物	1,917,488.80	5.42
84	002317	众生药业	1,877,557.48	5.31
85	600252	中恒集团	1,874,030.36	5.30
86	300017	网宿科技	1,866,021.00	5.28
87	600718	东软集团	1,823,462.20	5.15
88	600303	曙光股份	1,783,686.64	5.04
89	600520	中发科技	1,777,645.00	5.03
90	002313	日海通讯	1,772,992.01	5.01
91	300284	苏交科	1,770,944.00	5.01
92	300250	初灵信息	1,759,137.46	4.97
93	300299	富春通信	1,756,245.00	4.96
94	300395	菲利华	1,727,395.00	4.88



95	000661	长春高新	1,727,187.00	4.88
96	000710	天兴仪表	1,721,438.66	4.87
97	300161	华中数控	1,701,205.00	4.81
98	000576	广东甘化	1,678,585.00	4.75
99	300019	硅宝科技	1,638,537.00	4.63
100	002599	盛通股份	1,635,968.00	4.62
101	002642	荣之联	1,598,556.00	4.52
102	002234	民和股份	1,587,475.00	4.49
103	000592	平潭发展	1,581,373.23	4.47
104	300162	雷曼股份	1,574,511.75	4.45
105	002605	姚记扑克	1,566,600.00	4.43
106	600017	日照港	1,564,947.00	4.42
107	600282	南钢股份	1,552,974.00	4.39
108	300251	光线传媒	1,550,632.46	4.38
109	600826	兰生股份	1,526,523.00	4.32
110	000892	*ST 星美	1,521,550.00	4.30
111	600571	信雅达	1,506,022.00	4.26
112	002390	信邦制药	1,490,414.45	4.21
113	603555	贵人鸟	1,479,652.00	4.18
114	002667	鞍重股份	1,479,386.00	4.18
115	300329	海伦钢琴	1,452,398.59	4.11
116	002089	新海宜	1,447,880.00	4.09
117	300096	易联众	1,439,827.00	4.07
118	300178	腾邦国际	1,427,389.00	4.04
119	000810	创维数字	1,425,050.00	4.03
120	300205	天喻信息	1,420,000.00	4.01
121	002259	升达林业	1,396,346.40	3.95
122	002279	久其软件	1,367,709.00	3.87
123	300427	红相电力	1,367,032.00	3.86
124	000423	东阿阿胶	1,364,557.24	3.86
125	002030	达安基因	1,340,500.00	3.79
126	600196	复星医药	1,331,591.00	3.76
127	300018	中元华电	1,324,800.00	3.75
128	000623	吉林敖东	1,317,175.96	3.72
129	000829	天音控股	1,304,953.00	3.69
130	300232	洲明科技	1,292,786.00	3.65
131	600645	中源协和	1,291,075.00	3.65
132	000538	云南白药	1,284,828.00	3.63

133	300203	聚光科技	1,258,236.00	3.56
134	002458	益生股份	1,248,200.00	3.53
135	000700	模塑科技	1,246,141.00	3.52
136	002226	江南化工	1,242,710.00	3.51
137	002429	兆驰股份	1,239,782.99	3.50
138	002299	圣农发展	1,237,758.20	3.50
139	600815	厦工股份	1,231,241.35	3.48
140	300247	乐金健康	1,200,166.00	3.39
141	300364	中文在线	1,197,091.05	3.38
142	000513	丽珠集团	1,193,498.66	3.37
143	600211	西藏药业	1,163,135.98	3.29
144	002548	金新农	1,157,677.00	3.27
145	600581	八一钢铁	1,133,341.80	3.20
146	300450	先导智能	1,131,345.00	3.20
147	300136	信维通信	1,128,298.20	3.19
148	002007	华兰生物	1,127,389.00	3.19
149	002450	康得新	1,115,081.00	3.15
150	600080	金花股份	1,106,894.00	3.13
151	002294	信立泰	1,100,330.00	3.11
152	603885	吉祥航空	1,097,676.10	3.10
153	002354	天神娱乐	1,094,973.00	3.10
154	300030	阳普医疗	1,083,894.00	3.06
155	002513	蓝丰生化	1,075,012.00	3.04
156	000687	华讯方舟	1,074,692.00	3.04
157	002022	科华生物	1,070,250.00	3.03
158	002717	岭南园林	1,050,070.00	2.97
159	600343	航天动力	1,044,737.00	2.95
160	300353	东土科技	1,035,270.00	2.93
161	600217	*ST 秦岭	1,033,000.00	2.92
162	002776	柏堡龙	1,031,573.00	2.92
163	300275	梅安森	1,028,068.00	2.91
164	600337	美克家居	1,024,594.72	2.90
165	000555	神州信息	1,018,007.00	2.88
166	000961	中南建设	1,009,363.99	2.85
167	002355	兴民钢圈	1,003,255.00	2.84
168	300113	顺网科技	1,001,856.00	2.83
169	600329	中新药业	1,000,069.21	2.83
170	300166	东方国信	978,075.00	2.77

171	002437	誉衡药业	972,652.00	2.75
172	300135	宝利国际	971,865.00	2.75
173	000797	中国武夷	966,328.00	2.73
174	002651	利君股份	939,070.00	2.65
175	300369	绿盟科技	937,179.00	2.65
176	600146	大元股份	933,494.99	2.64
177	600085	同仁堂	923,972.00	2.61
178	300282	汇冠股份	919,387.00	2.60
179	600461	洪城水业	912,865.00	2.58
180	300314	戴维医疗	910,907.00	2.58
181	002348	高乐股份	904,103.00	2.56
182	600222	太龙药业	902,800.00	2.55
183	300238	冠昊生物	889,450.00	2.51
184	300204	舒泰神	886,152.60	2.51
185	300396	迪瑞医疗	883,334.60	2.50
186	002223	鱼跃医疗	880,467.10	2.49
187	002055	得润电子	879,280.00	2.49
188	000021	深科技	879,275.00	2.49
189	002172	澳洋科技	871,528.42	2.46
190	300239	东宝生物	869,054.79	2.46
191	601628	中国人寿	855,852.00	2.42
192	002701	奥瑞金	855,046.00	2.42
193	000590	*ST 古汉	853,677.00	2.41
194	300294	博雅生物	840,721.00	2.38
195	000915	山大华特	832,202.00	2.35
196	002568	百润股份	816,817.00	2.31
197	603678	火炬电子	802,430.00	2.27
198	002381	双箭股份	800,312.00	2.26
199	601688	华泰证券	796,879.00	2.25
200	600598	北大荒	793,760.00	2.24
201	002583	海能达	793,573.00	2.24
202	600108	亚盛集团	778,436.00	2.20
203	002229	鸿博股份	774,015.00	2.19
204	002737	葵花药业	773,496.00	2.19
205	603669	灵康药业	766,723.00	2.17
206	600285	羚锐制药	762,763.00	2.16
207	002020	京新药业	731,563.00	2.07
208	600804	鹏博士	710,704.00	2.01

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	509,600,438.16
卖出股票收入（成交）总额	507,143,397.74

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。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,376.57
2	应收证券清算款	1,442,476.32
3	应收股利	-
4	应收利息	1,026.77
5	应收申购款	19,309.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,532,189.35

### 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	600682	南京新百	3,072,804.00	6.57	重大事项停牌

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,284	16,464.21	5,024,120.60	13.36%	32,580,129.44	86.64%

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
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	9,915.53	0.0300%

### 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	份额级别	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	大成健康产业	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成健康产业	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月28日）基金份额总额	322,007,363.05
本报告期期初基金份额总额	36,061,686.85
本报告期基金总申购份额	146,106,349.71
减：本报告期基金总赎回份额	144,563,786.52
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	37,604,250.04

## § 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

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期应支付的审计费用为 3 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	322,396,177.88	31.71%	287,250.58	31.34%	-
财富证券	1	117,996,363.46	11.61%	107,044.76	11.68%	-
招商证券	2	100,146,592.77	9.85%	91,240.28	9.95%	-
东方证券	1	77,565,577.27	7.63%	71,013.93	7.75%	-
华林证券	1	59,788,403.38	5.88%	53,093.53	5.79%	-
东吴证券	1	54,010,348.78	5.31%	49,126.52	5.36%	-
光大证券	2	43,788,833.21	4.31%	39,906.80	4.35%	-
申银万国	1	35,651,910.60	3.51%	31,548.47	3.44%	-
长江证券	1	31,395,106.39	3.09%	28,582.22	3.12%	-
华鑫证券	1	28,324,190.00	2.79%	26,137.30	2.85%	-
英大证券	1	28,318,264.76	2.79%	25,058.86	2.73%	-
中航证券	1	26,452,685.95	2.60%	23,408.22	2.55%	-
银河证券	1	19,192,834.23	1.89%	17,874.06	1.95%	-
江海证券	1	16,376,854.61	1.61%	15,160.24	1.65%	-



华福证券	1	13,489,680.44	1.33%	12,280.98	1.34%	-
西南证券	1	10,779,099.80	1.06%	9,813.37	1.07%	-
齐鲁证券	2	9,589,232.51	0.94%	8,930.45	0.97%	-
长城证券	1	9,351,867.34	0.92%	8,275.19	0.90%	-
万和证券	1	7,651,609.38	0.75%	6,966.04	0.76%	-
民生证券	1	2,606,033.14	0.26%	2,306.10	0.25%	-
中投证券	3	1,028,385.00	0.10%	957.72	0.10%	-
国海证券	1	707,880.00	0.07%	626.41	0.07%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投

资组合证券交易需要；

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：长城证券。退出交易单元：万和证券。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万和证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

大成基金管理有限公司  
2016年3月26日