

大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)  
2015 年半年度报告摘要  
2015 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：2015 年 8 月 27 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。

大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原景宏证券投资基金转型而来。根据《景宏证券投资基金招募说明书》，原景宏证券投资基金为契约型封闭式基金，存续期为 15 年。原景宏证券投资基金于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易。根据深交所深证上[2014]127 号《终止上市通知书》，原景宏证券投资基金于 2014 年 4 月 9 日终止上市权利登记，并于 2014 年 4 月 10 日终止上市。自 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)起，原景宏证券投资基金自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)，《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同日生效。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 24 日起本基金名称变更为“大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)”；基金简称“大成中小盘”和基金代码“160918”不发生变更；基金类别变更为“混合型”。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，基金管理人对《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，本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，《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)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 2015 年 8 月 25 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 2015 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	大成中小盘(LOF)
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
交易代码	160918
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月10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	241,156,259.57份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-04-30

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，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，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险收益特征的开放式基金。

### 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	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及投资者服务部

## § 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	279,527,358.84
本期利润	189,135,431.22
加权平均基金份额本期利润	0.6803
本期基金份额净值增长率	78.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.8460
期末基金资产净值	445,169,554.75
期末基金份额净值	1.846

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。

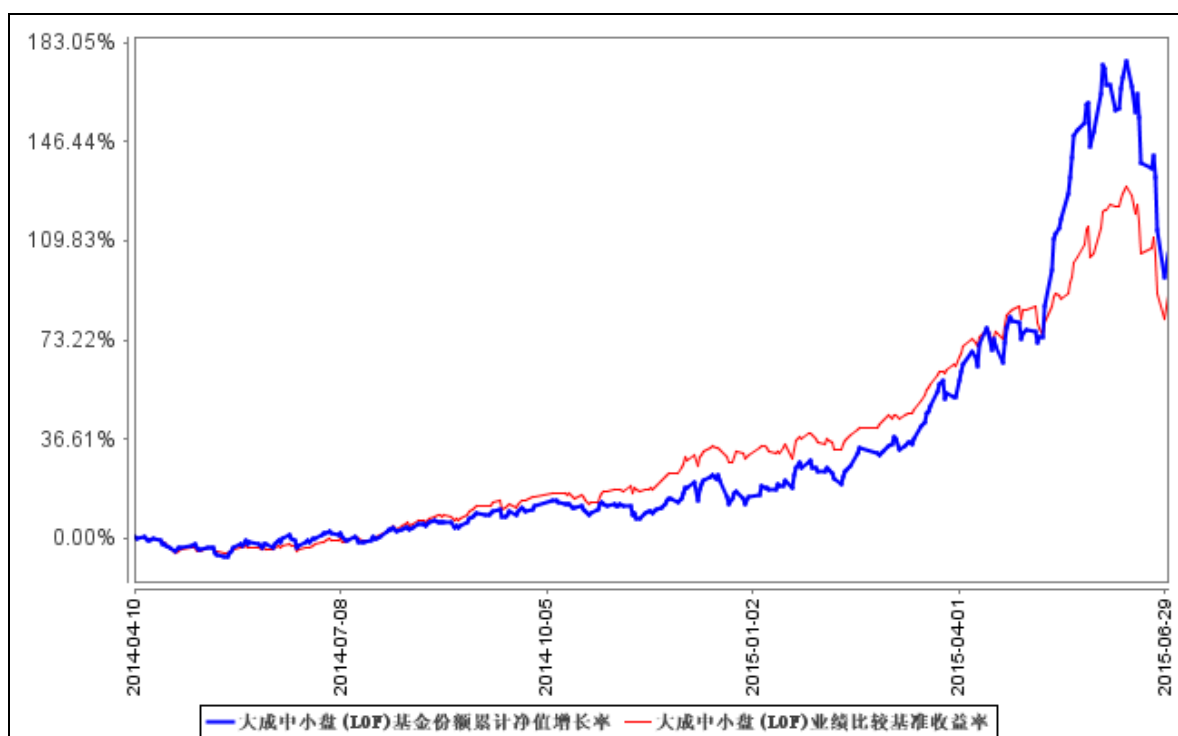
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-17.92%	4.00%	-7.78%	3.04%	-10.14%	0.96%
过去三个月	34.55%	3.39%	15.68%	2.31%	18.87%	1.08%
过去六个月	78.01%	2.69%	44.72%	1.84%	33.29%	0.85%

过去一年	102.41%	2.09%	92.53%	1.45%	9.88%	0.64%
自基金合同生效起至今	104.93%	1.94%	89.35%	1.35%	15.58%	0.59%

### 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、本基金于 2014 年 4 月 10 日转型，截至报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金投资的好莱客（603898）因重要事项停牌，导致投资比例被动超标。除此之外，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 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 51 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及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 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		
魏庆国先	本基金基	2015 年 4 月 7	-	6 年	经济学硕士。2010 年至 2012

生	金经理	日			<p>年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员；2012年至2013年任职于平安大华基金研究部；2013年5月加入大成基金管理有限公司。</p> <p>2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日至2015年7月23日起担任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2015年7月24日起任大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年4月7日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日起任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。</p>
刘安田先生	本基金基金经理	2014年4月10日	2015年4月6日	11年	<p>金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金,历任大成基金管理有限公司研究部总监助理、股票投资部混合组投资总监。2012年3月20日至2013年7月17日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。2013年3月8日至2014年4月9日任景宏证券投资基金基金经理。2010年4月7日至2015年4月6日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2014年4月10日至2015年4月6日任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。</p> <p>国籍:中国</p>
侯春燕女士	本基金基金经理助理	2012年11月8日	2015年3月30日	5年	<p>经济学硕士,2010年6月加入大成基金管理有限公司。</p>



	理		日		2012年11月8日至2015年3月30日担任景宏证券投资基金基金经理助理（该基金于2014年4月10日转型成为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)）。2012年11月8日至2013年3月11日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2013年3月11日至2015年3月30日担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理助理。2015年3月30日起担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。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》、《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)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。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 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，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；投资组合间存在 1 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 and 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

本基金继续坚持稳定的投资策略，重点投资以下几类股票：1) 成长股：类 VC 阶段的成长股、经典成长股和泡沫化阶段的成长股；2) 重大资产重组导致企业基本面发生彻底变化，复牌后第二波投资机会；3) 强者恒强的热门股。

本基金完全坚持自下而上的选股方式，但是从最终的结果看，主要投资了互联网+X、医疗服务、新兴消费品和核电等有远大前景的行业。

本基金一季度的失误是前期并未积极投身于泡沫之中，二季度的主要失误在于看到了泡沫破裂的顶部抛售信号但没有及时抽身而出。

##### 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 1.846 元，本报告期基金份额净值增长率为 78.01%，同期业绩比较基准收益率为 44.72%，高于业绩比较基准的表现。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于 A 股目前已经有近 2800 家上市公司，构建一个基金组合仅需要 20 只股票，所以本基金放弃基于风格、主题、行业等配置思路，完全基于自下而上的选股。

展望下半年，本基金将继续坚持稳定的投资策略，但相比于上半年操作方式上可能会做出一些调整来应对下半年波动加大的市场。如果上半年主要防范上行风险，下半年将主要防范下行风险。本基金将通过加强交易和个股仓位控制来控制回撤风险，并且在选股中更加注重企业质地，并且强化对个股止损纪律的要求。

#### 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

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。

#### 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”）在大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）（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：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	72,045,004.29	37,034,824.75
结算备付金	7,022,381.46	612,559.89
存出保证金	332,104.15	361,389.62
交易性金融资产	419,455,503.92	328,553,234.25
其中：股票投资	419,455,503.92	328,553,234.25
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	12,579.27	7,144.34
应收股利	-	-
应收申购款	921,931.80	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	499,789,504.89	366,569,152.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015年6月30日</b>	<b>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	37,799,721.43	556.38
应付赎回款	11,228,493.46	475,198.14
应付管理人报酬	788,510.16	612,528.89
应付托管费	131,418.38	102,088.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,968,131.23	496,235.03
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	703,675.48	785,000.00
负债合计	54,619,950.14	2,471,606.60
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	241,156,259.57	351,218,842.97
未分配利润	204,013,295.18	12,878,703.28
所有者权益合计	445,169,554.75	364,097,546.25
负债和所有者权益总计	499,789,504.89	366,569,152.85

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.846 元，基金份额总额 241,156,259.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

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 6 月 30 日	2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

一、收入	202,706,166.45	-21,052,518.70
1. 利息收入	216,231.91	628,073.77
其中：存款利息收入	216,231.91	520,821.46
债券利息收入	-	107,252.31
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）	290,373,767.76	-1,469,529.20
其中：股票投资收益	289,973,826.68	-4,746,789.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-1,101,483.95
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	399,941.08	4,378,744.15
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-90,391,927.62	-25,309,505.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,508,094.40	5,098,442.34
<b>减：二、费用</b>	<b>13,570,735.23</b>	<b>6,869,241.73</b>
1. 管理人报酬	3,150,760.27	3,966,386.83
2. 托管费	525,126.76	661,064.52
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,619,073.22	2,126,646.08
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	275,774.98	115,144.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>189,135,431.22</b>	<b>-27,921,760.43</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>189,135,431.22</b>	<b>-27,921,760.43</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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)	351,218,842.97	12,878,703.28	364,097,546.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	189,135,431.22	189,135,431.22
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)	-110,062,583.40	1,999,160.68	-108,063,422.72
其中：1.基金申购款	168,607,129.29	207,917,445.28	376,524,574.57
2.基金赎回款	-278,669,712.69	-205,918,284.60	-484,587,997.29
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)	241,156,259.57	204,013,295.18	445,169,554.75
项目	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效日)至2014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)	2,000,000,000.00	-198,481,383.81	1,801,518,616.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-27,921,760.43	-27,921,760.43
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)	-1,196,138,924.09	155,825,693.67	-1,040,313,230.42
其中：1.基金申购款	82,660.91	-13,464.10	69,196.81
2.基金赎回款	-1,196,221,585.00	155,839,157.77	-1,040,382,427.23
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)	803,861,075.91	-70,577,450.57	733,283,625.34

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

肖剑

范瑛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 会计政策和会计估计变更的说明

#### 6.4.1.1 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一致。

#### 6.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.3.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
光大证券	-	0.00%	12,720,309.20	1.08%



## 6.4.3.1.2 权证交易

无。

## 6.4.3.1.3 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6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	-	0.00%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效日)至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	11,256.39	1.07%	11,256.39	0.87%

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。

## 6.4.3.2 关联方报酬

## 6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,150,760.27	3,966,386.83
其中：支付销售机构的客户维护费	130,699.98	-

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1.5%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 X 1.5% / 当年天数。

## 6.4.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效 日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	525,126.76	661,064.52

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 X 0.25% / 当年天数。

## 6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效 日)至2014年6月30日
基金合同生效日(2014年4月10日)持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期初持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.98%	1.49%

注：1、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金，自基金合同生效日起所持有的份额由基金转型而来。

2、本基金管理人投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

## 6.4.3.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
光大证券	6,000,000.00	2.49%	6,000,000.00	1.71%
广东证券	6,000,000.00	2.49%	6,000,000.00	1.71%

#### 6.4.3.5 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6月30日		上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同生效日)至2014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	72,045,004.29	183,374.67	87,828,926.46	515,102.38

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。

#### 6.4.3.6 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。

#### 6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.4 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.4.2 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
002044	江 苏 三 友	2015-6-18	重 大 事 项	44.80	2015-7-1	49.50	455,490	20,650,394.51	20,405,952.00	-
603898	好 莱 客	2015-6-15	重 大 事 项	109.47			468,110	46,966,321.30	51,244,001.70	-
002665	首 航 节	2015-6-30	重 大 事 项	27.70	2015-7-1	30.00	663,450	23,166,392.81	18,377,565.00	-

	能		项							
300096	易联众	2015-5-28	重大事 项	28.40			437,300	12,152,050.00	12,419,320.00	-

注：本基金截至2015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。

#### 6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## §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	419,455,503.92	83.93
	其中：股票	419,455,503.92	83.93
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	79,067,385.75	15.82
7	其他各项资产	1,266,615.22	0.25
8	合计	499,789,504.89	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	8,458,560.00	1.90

B	采矿业	-	0.00
C	制造业	289,131,125.14	64.95
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	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	27,415,358.40	6.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,603,312.00	10.47
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	20,436,121.68	4.59
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	27,411,026.70	6.16
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	419,455,503.92	94.22

## 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	603898	好莱客	468,110	51,244,001.70	11.51
2	300078	中瑞思创	451,100	30,557,514.00	6.86
3	600305	恒顺醋业	915,800	27,648,002.00	6.21
4	000796	易食股份	1,105,458	27,415,358.40	6.16
5	300244	迪安诊断	326,555	27,411,026.70	6.16
6	600480	凌云股份	1,047,750	24,684,990.00	5.55
7	000910	大亚科技	1,300,408	22,132,944.16	4.97
8	002077	大港股份	1,121,016	20,436,121.68	4.59
9	002044	江苏三友	455,490	20,405,952.00	4.58
10	002366	丹甫股份	263,300	19,320,954.00	4.34

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	603898	好莱客	80,106,217.78	22.00
2	300075	数字政通	69,697,222.17	19.14
3	000910	大亚科技	68,418,202.59	18.79
4	002366	丹甫股份	67,254,787.41	18.47
5	600038	中直股份	66,187,652.65	18.18
6	000078	海王生物	65,054,017.86	17.87
7	002044	江苏三友	54,467,531.50	14.96
8	000810	创维数字	53,640,197.66	14.73
9	002410	广联达	52,645,528.09	14.46
10	002251	步步高	48,701,944.67	13.38
11	002009	天奇股份	48,217,582.47	13.24
12	300273	和佳股份	47,531,691.08	13.05
13	300244	迪安诊断	47,331,142.91	13.00
14	300012	华测检测	45,394,427.27	12.47
15	600571	信雅达	41,902,354.13	11.51
16	600480	凌云股份	40,221,047.49	11.05
17	300246	宝莱特	39,461,464.26	10.84
18	002665	首航节能	39,257,553.31	10.78
19	002711	欧浦钢网	39,088,870.72	10.74
20	000802	北京文化	38,719,188.58	10.63
21	002468	艾迪西	36,930,879.33	10.14
22	000816	智慧农业	35,558,337.05	9.77
23	300078	中瑞思创	33,849,530.91	9.30
24	002612	朗姿股份	33,006,485.31	9.07
25	002284	亚太股份	32,953,275.76	9.05
26	300049	福瑞股份	31,488,968.53	8.65
27	000796	易食股份	31,457,094.61	8.64
28	600305	恒顺醋业	30,324,559.50	8.33

29	000566	海南海药	29,636,841.96	8.14
30	002230	科大讯飞	29,414,752.78	8.08
31	300011	鼎汉技术	28,792,240.46	7.91
32	300019	硅宝科技	28,684,815.77	7.88
33	002256	彩虹精化	28,230,193.31	7.75
34	002169	智光电气	27,130,949.47	7.45
35	002439	启明星辰	25,979,938.60	7.14
36	002049	同方国芯	25,979,758.17	7.14
37	600050	中国联通	24,564,880.00	6.75
38	600343	航天动力	24,481,904.00	6.72
39	002077	大港股份	24,343,790.74	6.69
40	603088	宁波精达	24,334,945.75	6.68
41	600280	中央商场	24,294,440.00	6.67
42	002363	隆基机械	23,822,918.72	6.54
43	603899	晨光文具	22,622,276.16	6.21
44	600048	保利地产	21,834,649.95	6.00
45	300017	网宿科技	21,365,017.55	5.87
46	600713	南京医药	21,302,672.22	5.85
47	601318	中国平安	21,181,772.00	5.82
48	600525	长园集团	21,153,261.87	5.81
49	600198	大唐电信	21,092,276.24	5.79
50	002467	二六三	20,863,290.80	5.73
51	000839	中信国安	20,816,702.88	5.72
52	002402	和而泰	20,309,982.52	5.58
53	600684	珠江实业	20,304,347.92	5.58
54	002405	四维图新	20,244,049.32	5.56
55	002055	得润电子	20,105,482.24	5.52
56	002651	利君股份	19,753,313.51	5.43
57	002475	立讯精密	19,752,502.50	5.43
58	002714	牧原股份	19,609,274.74	5.39
59	300352	北信源	18,859,134.04	5.18
60	300369	绿盟科技	18,733,222.50	5.15
61	000503	海虹控股	18,346,048.68	5.04
62	000002	万科A	18,081,000.00	4.97
63	600873	梅花生物	17,805,420.03	4.89
64	002396	星网锐捷	17,503,459.20	4.81

65	601601	中国太保	17,286,284.00	4.75
66	002171	楚江新材	16,546,708.02	4.54
67	000024	招商地产	16,222,496.22	4.46
68	002572	索菲亚	15,386,702.78	4.23
69	600055	华润万东	15,348,039.19	4.22
70	600547	山东黄金	14,952,571.45	4.11
71	002253	川大智胜	14,794,901.10	4.06
72	600993	马应龙	14,711,311.34	4.04
73	002142	宁波银行	14,555,405.87	4.00
74	300239	东宝生物	14,513,996.54	3.99
75	600036	招商银行	14,388,506.87	3.95
76	002183	怡亚通	14,345,512.02	3.94
77	300263	隆华节能	14,309,459.81	3.93
78	600028	中国石化	14,300,304.00	3.93
79	300030	阳普医疗	14,195,056.29	3.90
80	600271	航天信息	14,133,967.04	3.88
81	300332	天壕节能	14,103,727.65	3.87
82	002153	石基信息	14,002,578.69	3.85
83	002488	金固股份	14,001,461.00	3.85
84	600576	万好万家	13,827,796.00	3.80
85	000948	南天信息	13,600,345.35	3.74
86	002614	蒙发利	13,446,683.46	3.69
87	300159	新研股份	13,331,489.00	3.66
88	002751	易尚展示	13,271,219.00	3.64
89	002721	金一文化	12,937,049.00	3.55
90	600990	四创电子	12,883,444.40	3.54
91	002030	达安基因	12,796,790.04	3.51
92	300096	易联众	12,152,050.00	3.34
93	002385	大北农	11,925,681.90	3.28
94	300147	香雪制药	11,914,939.66	3.27
95	600060	海信电器	11,622,227.50	3.19
96	600682	南京新百	11,305,432.86	3.11
97	002303	美盈森	11,230,689.08	3.08
98	603030	全筑股份	10,918,064.00	3.00
99	002514	宝馨科技	10,903,585.60	2.99
100	600277	亿利能源	10,855,399.40	2.98



101	002115	三维通信	10,641,775.08	2.92
102	000712	锦龙股份	10,612,942.69	2.91
103	002573	清新环境	10,407,414.81	2.86
104	000997	新大陆	10,244,741.00	2.81
105	600687	刚泰控股	10,167,564.80	2.79
106	000858	五粮液	10,127,073.00	2.78
107	601166	兴业银行	10,104,080.00	2.78
108	300380	安硕信息	9,186,323.61	2.52
109	300212	易华录	8,286,302.00	2.28
110	603001	奥康国际	8,255,910.44	2.27
111	000701	厦门信达	8,248,976.00	2.27
112	300182	捷成股份	8,167,136.00	2.24
113	603111	康尼机电	8,045,730.22	2.21
114	000006	深振业A	8,013,735.09	2.20
115	601688	华泰证券	7,976,947.72	2.19
116	600138	中青旅	7,852,387.50	2.16
117	600839	四川长虹	7,750,123.62	2.13
118	002496	辉丰股份	7,728,956.00	2.12
119	002594	比亚迪	7,640,628.74	2.10
120	300081	恒信移动	7,618,129.00	2.09
121	300041	回天新材	7,588,212.68	2.08
122	002235	安妮股份	7,477,609.90	2.05
123	000681	视觉中国	7,473,873.40	2.05
124	001696	宗申动力	7,471,378.00	2.05
125	300058	蓝色光标	7,436,879.72	2.04
126	600446	金证股份	7,396,545.19	2.03
127	600593	大连圣亚	7,384,479.94	2.03
128	002050	三花股份	7,382,433.00	2.03
129	300124	汇川技术	7,364,991.67	2.02
130	600643	爱建股份	7,360,180.65	2.02
131	300341	麦迪电气	7,357,845.38	2.02
132	002642	荣之联	7,355,568.09	2.02
133	300016	北陆药业	7,354,853.00	2.02
134	002072	凯瑞德	7,314,359.00	2.01
135	300350	华鹏飞	7,288,417.96	2.00

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	300075	数字政通	78,737,388.04	21.63
2	000078	海王生物	74,842,768.59	20.56
3	600571	信雅达	68,607,169.79	18.84
4	300011	鼎汉技术	66,014,001.28	18.13
5	600038	中直股份	63,117,269.38	17.34
6	000810	创维数字	59,824,949.72	16.43
7	002410	广联达	57,406,386.25	15.77
8	002251	步步高	57,292,269.86	15.74
9	002009	天奇股份	56,773,434.22	15.59
10	002366	丹甫股份	56,161,687.13	15.42
11	002555	顺荣三七	53,742,111.86	14.76
12	300273	和佳股份	46,126,338.36	12.67
13	300012	华测检测	45,863,587.49	12.60
14	300049	福瑞股份	45,799,710.90	12.58
15	000910	大亚科技	41,494,381.79	11.40
16	603898	好莱客	41,123,820.82	11.29
17	000816	智慧农业	39,520,361.65	10.85
18	600055	华润万东	39,147,653.87	10.75
19	002284	亚太股份	38,709,948.16	10.63
20	300246	宝莱特	37,443,306.00	10.28
21	002044	江苏三友	36,897,347.34	10.13
22	000566	海南海药	36,734,939.88	10.09
23	000802	北京文化	36,107,313.86	9.92
24	002439	启明星辰	35,348,002.84	9.71
25	300019	硅宝科技	34,994,341.05	9.61
26	000625	长安汽车	27,129,073.16	7.45
27	002711	欧浦钢网	26,394,230.63	7.25
28	600280	中央商场	25,271,981.62	6.94
29	002256	彩虹精化	24,644,751.42	6.77
30	600050	中国联通	24,322,468.44	6.68
31	603899	晨光文具	24,107,494.90	6.62
32	002179	中航光电	23,905,928.78	6.57

33	002049	同方国芯	23,577,750.18	6.48
34	600277	亿利能源	23,439,831.13	6.44
35	600340	华夏幸福	22,668,644.62	6.23
36	600525	长园集团	22,609,714.73	6.21
37	300244	迪安诊断	22,258,779.58	6.11
38	300124	汇川技术	21,859,501.28	6.00
39	300017	网宿科技	21,695,190.03	5.96
40	600343	航天动力	21,596,597.40	5.93
41	603088	宁波精达	21,033,285.99	5.78
42	601318	中国平安	20,907,331.52	5.74
43	600684	珠江实业	20,743,807.62	5.70
44	300131	英唐智控	20,333,753.22	5.58
45	002467	二六三	20,300,136.02	5.58
46	002721	金一文化	20,280,340.86	5.57
47	600048	保利地产	20,139,711.52	5.53
48	002614	蒙发利	20,028,047.60	5.50
49	002402	和而泰	19,824,612.00	5.44
50	002475	立讯精密	19,728,570.16	5.42
51	002055	得润电子	19,591,045.40	5.38
52	002651	利君股份	19,456,231.70	5.34
53	002169	智光电气	18,875,103.04	5.18
54	000839	中信国安	18,715,931.68	5.14
55	000503	海虹控股	18,619,278.72	5.11
56	002405	四维图新	18,598,658.55	5.11
57	600682	南京新百	18,365,791.12	5.04
58	000768	中航飞机	18,335,911.26	5.04
59	600713	南京医药	18,208,256.43	5.00
60	000002	万科A	18,180,945.79	4.99
61	600990	四创电子	18,111,706.67	4.97
62	300239	东宝生物	18,070,933.69	4.96
63	000948	南天信息	17,928,624.15	4.92
64	002396	星网锐捷	17,869,041.22	4.91
65	002292	奥飞动漫	17,720,057.36	4.87
66	600873	梅花生物	17,718,280.33	4.87
67	600271	航天信息	17,213,469.66	4.73
68	601601	中国太保	17,066,298.60	4.69
69	300352	北信源	16,865,025.80	4.63
70	000024	招商地产	16,703,769.00	4.59

71	002230	科大讯飞	15,820,159.50	4.35
72	002253	川大智胜	15,734,140.52	4.32
73	300147	香雪制药	15,615,728.05	4.29
74	002572	索菲亚	15,507,279.64	4.26
75	002171	楚江新材	15,360,004.40	4.22
76	002142	宁波银行	15,305,972.34	4.20
77	002665	首航节能	15,128,298.49	4.16
78	600547	山东黄金	15,061,326.00	4.14
79	600576	万好万家	15,036,818.97	4.13
80	300332	天壕节能	14,819,577.00	4.07
81	002183	怡亚通	14,656,592.33	4.03
82	300263	隆华节能	14,582,009.11	4.00
83	600993	马应龙	14,334,220.82	3.94
84	600036	招商银行	14,222,337.96	3.91
85	600028	中国石化	14,077,736.00	3.87
86	002612	朗姿股份	13,949,092.67	3.83
87	002488	金固股份	13,819,780.96	3.80
88	002153	石基信息	13,766,600.18	3.78
89	300284	苏文科	13,705,982.25	3.76
90	002030	达安基因	13,625,435.76	3.74
91	002610	爱康科技	13,588,876.87	3.73
92	000997	新大陆	13,367,039.60	3.67
93	300159	新研股份	13,307,584.00	3.65
94	300007	汉威电子	13,057,086.58	3.59
95	002573	清新环境	12,781,709.76	3.51
96	002390	信邦制药	12,720,862.78	3.49
97	600198	大唐电信	12,642,004.44	3.47
98	600309	万华化学	12,441,493.31	3.42
99	300030	阳普医疗	12,415,889.47	3.41
100	300224	正海磁材	12,265,657.43	3.37
101	600060	海信电器	12,235,792.38	3.36
102	002714	牧原股份	12,129,221.54	3.33
103	300070	碧水源	11,840,345.79	3.25
104	300315	掌趣科技	11,694,652.80	3.21
105	600118	中国卫星	11,660,712.47	3.20
106	002385	大北农	11,651,180.66	3.20
107	002146	荣盛发展	11,519,717.25	3.16
108	000712	锦龙股份	10,780,970.00	2.96

109	002303	美盈森	10,745,835.79	2.95
110	603030	全筑股份	10,722,869.00	2.95
111	000006	深振业A	10,695,863.00	2.94
112	600687	刚泰控股	10,637,548.78	2.92
113	002115	三维通信	10,528,200.23	2.89
114	002514	宝馨科技	10,456,728.28	2.87
115	000858	五粮液	10,217,314.74	2.81
116	002468	艾迪西	10,212,830.77	2.80
117	601166	兴业银行	9,821,068.00	2.70
118	300380	安硕信息	9,387,241.00	2.58
119	600138	中青旅	9,188,019.07	2.52
120	300236	上海新阳	9,165,375.67	2.52
121	002185	华天科技	9,054,400.88	2.49
122	300010	立思辰	9,053,641.17	2.49
123	300350	华鹏飞	8,902,212.49	2.45
124	002050	三花股份	8,820,003.77	2.42
125	002022	科华生物	8,660,837.90	2.38
126	300028	金亚科技	8,555,624.00	2.35
127	002103	广博股份	8,503,338.36	2.34
128	000681	视觉中国	8,442,024.39	2.32
129	000848	承德露露	8,283,541.39	2.28
130	603001	奥康国际	8,270,017.33	2.27
131	300041	回天新材	8,056,995.84	2.21
132	002496	辉丰股份	8,011,215.66	2.20
133	300182	捷成股份	7,988,773.76	2.19
134	002642	荣之联	7,986,824.41	2.19
135	600480	凌云股份	7,917,019.65	2.17
136	603111	康尼机电	7,911,582.55	2.17
137	300324	旋极信息	7,877,728.25	2.16
138	600153	建发股份	7,838,077.36	2.15
139	601688	华泰证券	7,803,761.00	2.14
140	600839	四川长虹	7,725,732.00	2.12
141	001696	宗申动力	7,662,866.28	2.10
142	002594	比亚迪	7,651,539.84	2.10
143	300058	蓝色光标	7,648,873.63	2.10
144	601021	春秋航空	7,621,998.20	2.09
145	000701	厦门信达	7,621,676.99	2.09
146	300347	泰格医药	7,577,999.85	2.08

147	002072	凯瑞德	7,477,379.48	2.05
148	600446	金证股份	7,470,441.81	2.05
149	300212	易华录	7,431,709.63	2.04
150	600593	大连圣亚	7,424,866.90	2.04
151	300220	金运激光	7,369,448.00	2.02
152	002368	太极股份	7,339,073.20	2.02
153	600783	鲁信创投	7,317,944.00	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。

#### 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	3,126,950,953.84
卖出股票收入（成交）总额	3,235,630,583.23

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

#### 7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 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。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	332,104.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,579.27
5	应收申购款	921,931.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,266,615.22

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603898	好莱客	51,244,001.70	11.51	重大事项
2	002044	江苏三友	20,405,952.00	4.58	重大事项

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
19,338	12,470.59	46,543,231.00	19.30%	194,613,028.57	80.70%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	大成基金管理有限公司	12,000,000.00	6.83%
2	广东证券股份有限公司	6,000,000.00	3.41%
3	光大证券股份有限公司	6,000,000.00	3.41%
4	中经信投资有限公司	6,000,000.00	3.41%
5	上海久辉工贸有限公司	2,900,000.00	1.65%
6	联想投资有限公司	2,131,200.00	1.21%
7	北京德恒有限责任公司	2,100,000.00	1.20%
8	章禾	1,629,030.00	0.93%
9	上海铁路局企业年金计划—中国工商银行股份 有限公司	1,500,000.00	0.85%
10	徐惠清	1,340,000.00	0.76%

## 8.3 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	4,574.85	0.0019%

## 8.4 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、基金投资和研发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4月10日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	351,218,842.97
本报告期基金总申购份额	168,607,129.29
减：本报告期基金总赎回份额	278,669,712.69
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	241,156,259.57

## § 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。

## 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。

### 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，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金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。

### 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	
渤海证券	2	605,446,540.99	9.52%	535,764.41	9.44%	-
申银万国	1	546,366,607.93	8.59%	483,489.34	8.52%	-
齐鲁证券	2	440,219,183.09	6.92%	400,775.62	7.06%	-
英大证券	1	440,165,552.29	6.92%	389,503.84	6.86%	-
财富证券	1	435,771,458.60	6.85%	385,619.19	6.80%	-

国海证券	1	366,499,674.59	5.76%	324,319.20	5.72%	-
东吴证券	1	314,900,092.89	4.95%	278,657.26	4.91%	-
中投证券	3	314,010,789.21	4.94%	285,874.76	5.04%	-
长城证券	1	295,510,911.59	4.64%	261,502.16	4.61%	-
万联证券	1	275,093,942.98	4.32%	243,432.98	4.29%	-
招商证券	2	244,386,515.68	3.84%	216,258.25	3.81%	-
广州证券	1	236,598,935.17	3.72%	215,399.52	3.80%	-
中航证券	1	204,533,521.31	3.21%	180,993.90	3.19%	-
中金公司	2	197,151,219.40	3.10%	174,460.49	3.07%	-
安信证券	2	187,579,385.15	2.95%	166,382.91	2.93%	-
万和证券	1	160,059,919.26	2.52%	145,719.32	2.57%	-
华鑫证券	1	156,748,898.41	2.46%	142,704.56	2.52%	-
民族证券	1	147,749,049.09	2.32%	130,745.31	2.30%	-
国都证券	1	132,629,594.79	2.08%	117,363.41	2.07%	-
华宝证券	1	131,517,778.07	2.07%	116,380.41	2.05%	-
西南证券	1	115,506,862.42	1.82%	105,157.38	1.85%	-
长江证券	1	101,526,895.77	1.60%	92,429.89	1.63%	-
民生证券	1	89,387,998.18	1.40%	79,100.07	1.39%	-
广发证券	1	60,793,938.22	0.96%	55,346.16	0.98%	-
国信证券	1	47,843,483.23	0.75%	42,337.11	0.75%	-
东方证券	1	42,192,864.21	0.66%	38,412.57	0.68%	-
东海证券	1	41,303,170.22	0.65%	37,602.83	0.66%	-
中信证券	2	31,086,754.33	0.49%	28,301.72	0.50%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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。

本报告期内增加交易单元: 长城证券。

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

基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

2015 年 7 月 24 日, 基金管理人公告了《大成中小盘股票型证券投资基金 (LOF) 变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》, 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》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 24 日起本基金名称变更为“大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)”; 基金简称变更为“大成中小盘混合 (LOF)” (场内简称“大成小盘”和基金代码“160918”不发生变更); 基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

大成基金管理有限公司  
2015 年 8 月 27 日