

# 大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 2015 年年度报告

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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

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

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	61

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)
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	273,326,407.00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	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较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
注册地址		深圳市福田区深南大道	北京市西城区复兴门内大街 1

	7088 号招商银行大厦 32 层	号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	刘卓	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	广东省深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

## § 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 4 月 10 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	275,611,059.00	88,398,271.92
本期利润	271,476,646.48	49,223,575.76
加权平均基金份额本期利润	1.0215	0.0603
本期加权平均净值利润率	60.03%	6.50%
本期基金份额净值增长率	117.84%	15.12%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	305,355,939.24	12,878,703.28
期末可供分配基金份额利润	1.1172	0.0367
期末基金资产净值	617,332,828.67	364,097,546.25
期末基金份额净值	2.259	1.037
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	150.78%	15.12%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

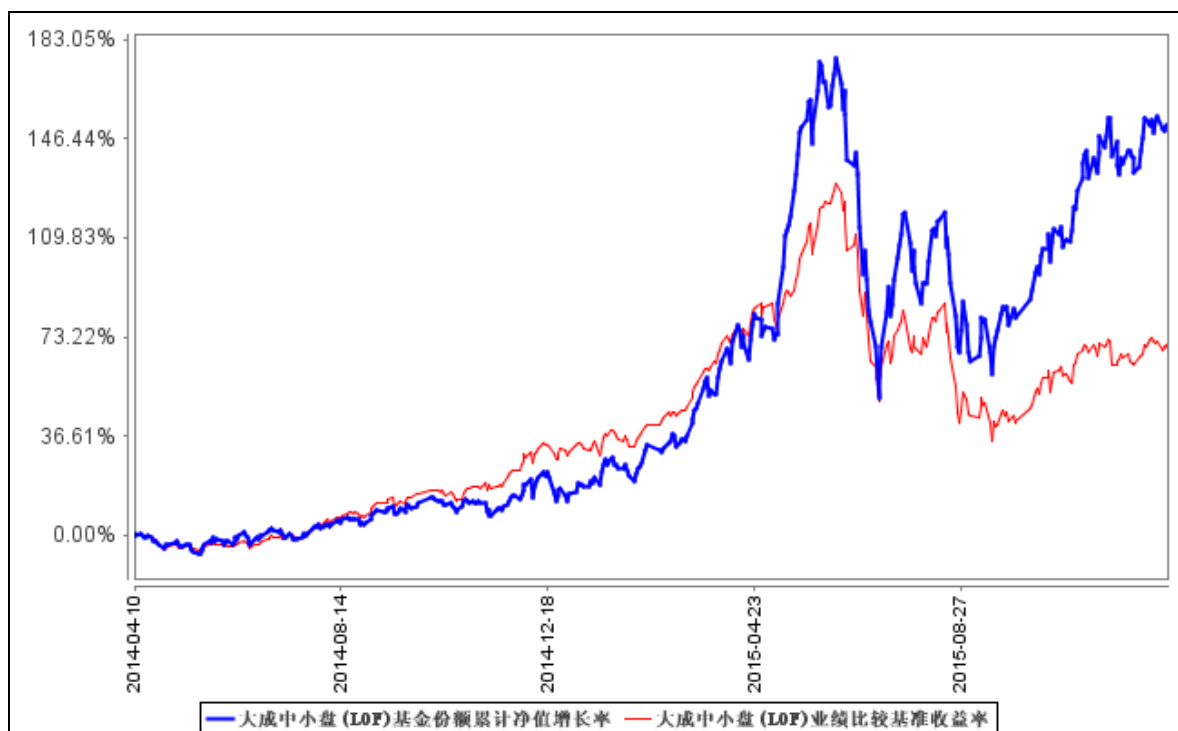
3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	39.19%	2.22%	18.37%	1.61%	20.82%	0.61%
过去六个月	22.37%	3.32%	-11.20%	2.54%	33.57%	0.78%
过去一年	117.84%	3.03%	28.51%	2.23%	89.33%	0.80%
自基金合同生效起至今	150.78%	2.43%	68.13%	1.79%	82.65%	0.64%

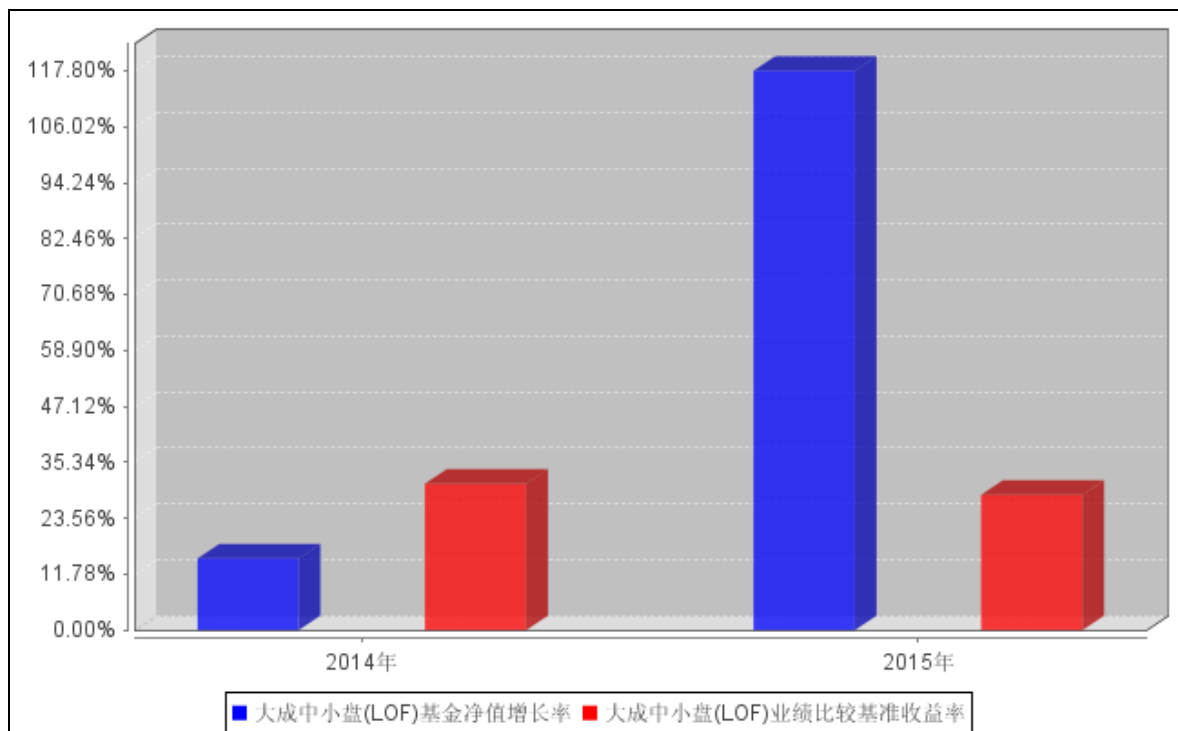
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日 2014 年 4 月 10 日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金转型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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2014 年 4 月 10 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		
魏庆国 庆先 生	本基金基金经理	2015 年 4 月 7 日	-	6 年	经济学硕士。2010 年至 2012 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。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。
刘安生	本基金基金经理	2014 年 4 月 10 日	2015 年 4 月 6 日	12 年	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。国籍: 中国
侯燕士	本基金基金经理助理	2012 年 11 月 8 日	2015 年 3 月 30 日	6 年	经济学硕士, 2010 年 6 月加入大成基金管理有限公司。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), 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)”)。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 4 月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 4 月起担任大成财富管理 2020 基金经理助理。2015 年 12 月 9 日起担任大成蓝筹稳健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》、《大成中小盘混合型证券投资基金 (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, 本基金的投资范围、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 年全年本基金的管理思路一直在市场的跌宕起伏中不断完善，最终的目的是构建一个稳定的交易系统，控制回撤，努力提高组合的回报率。

全年本基金一直坚持稳定的 5 类选股模式，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；4) 超跌反弹；5) 有基本面支撑中枢震荡突破。除此之外，四季度本基金尝试参与了少量“大集团小公司”的壳股票，核心逻辑是注册制尽管有望推出，但是壳公司价值依然明显。

本基金在 4 季度也逐步形成了目前的资金管理系统。选股系统和资金管理系统是独立正交的两个系统，他们共同构成组合管理。个股仓位管理的核心是分层次，而分层的依据是对于个股从基本面、走势和比价等独立角度去判断它的投资机会。多角度合力共振则加大下注比例，反之则反是。选股并不是买入并持有，而是不断从多角度去审视个股的变化，并通过个股仓位动态调整，实现整个组合的有纪律的进攻性。

本基金全年操作来看，到目前为止最大的缺憾始终是无法在市场出现顶部抛售信号，走势转入下跌趋势时，控制好自己的回撤。核心原因有两个：第一个是基金契约有 60% 下限仓位限制，任何时候都无法空仓规避下行趋势的风险，这个也是目前非灵活配置型基金的通病；第二个是本基金契约规定中小盘股票占比不得低于全部权益头寸的 80%，这导致了本基金也无法通过买入超级大盘股四大行两桶油来规避风险。

##### 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 2.259 元，本报告期基金份额净值增长率为 117.84%，同期业绩比较基准收益率为 28.51%，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。

对于未来，我们始终专注于研究一些有远大前景的产业，比如一些新技术、新消费、新服务、新材料、新制造等产业，本基金会把大量的资源投入到这些产业的研究和投资上。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基

金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

理。

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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分配利润。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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”）在大成中小盘混合型证券投资基金(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合规守信、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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) (原大成中小盘股票型证券投资基金(LOF))全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) (原大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)) (以下简称“大成中小盘混合基金(LOF)”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是大成中小盘混合基金(LOF)的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政</p>



	策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述大成中小盘混合基金(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成中小盘混合基金(LOF) 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（原大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)）

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	155,748,366.68	37,034,824.75
结算备付金		9,560,660.51	612,559.89
存出保证金		942,126.32	361,389.62
交易性金融资产	7.4.7.2	498,071,117.30	328,553,234.25
其中：股票投资		498,071,117.30	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	35,109.94	7,144.34
应收股利		-	-
应收申购款		3,490,908.49	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		667,848,289.24	366,569,152.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		42,642,705.92	556.38
应付赎回款		1,192,268.57	475,198.14
应付管理人报酬		727,081.64	612,528.89
应付托管费		121,180.28	102,088.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,270,428.75	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	7.4.7.8	561,795.41	785,000.00
负债合计		50,515,460.57	2,471,606.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	273,326,407.00	351,218,842.97
未分配利润	7.4.7.10	344,006,421.67	12,878,703.28
所有者权益合计		617,332,828.67	364,097,546.25
负债和所有者权益总计		667,848,289.24	366,569,152.85

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.259 元，基金份额总额 273,326,407.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（原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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年4月10日(基 金合同生效日)至 2014年12月31日
<b>一、收入</b>		304,621,424.24	63,881,578.43
1. 利息收入		712,582.57	938,865.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	712,582.57	776,685.23
债券利息收入		-	162,180.30
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）		302,186,262.73	95,572,855.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	301,747,215.08	91,706,601.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-1,425,520.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	439,047.65	5,291,774.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,134,412.52	-39,174,696.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,856,991.46	6,544,553.65
<b>减：二、费用</b>		33,144,777.76	14,658,002.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,721,750.90	8,328,931.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,120,291.78	1,388,155.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	24,839,825.80	4,540,688.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	462,909.28	400,226.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		271,476,646.48	49,223,575.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		271,476,646.48	49,223,575.76

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（原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）	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）	-	271,476,646.48	271,476,646.48

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)	-77,892,435.97	59,651,071.91	-18,241,364.06
其中: 1. 基金申购款	475,013,196.07	487,809,252.19	962,822,448.26
2. 基金赎回款	-552,905,632.04	-428,158,180.28	-981,063,812.32
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)	273,326,407.00	344,006,421.67	617,332,828.67
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)	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)	-	49,223,575.76	49,223,575.76
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)	-1,648,781,157.03	162,136,511.33	-1,486,644,645.70
其中: 1. 基金申购款	548,984.88	-12,917.26	536,067.62
2. 基金赎回款	-1,649,330,141.91	162,149,428.59	-1,487,180,713.32
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)	351,218,842.97	12,878,703.28	364,097,546.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>范瑛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)(原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。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

原景宏证券投资基金于 2014 年 4 月 9 日经基金管理人大成基金管理有限公司计算并经基金托管人中国银行股份有限公司确认的资产净值为 1,801,518,616.19 元，已于 2014 年 4 月 10 日全部转为本基金的基金资产净值。根据《大成基金管理有限公司关于景宏证券投资基金份额变更登记情况的公告》，本基金于 2014 年 4 月 11 日完成了份额变更登记。

经深交所深证上[2014]139 号文审核同意，本基金的 1,970,000,000 份基金份额于 2014 年 4 月 30 日在深交所挂牌交易。经本基金的基金管理人向深交所申请，原景宏证券投资基金发起人持有的未上市部分 30,000,000 份基金份额于 2014 年 5 月 9 日转流通。

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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据)、权证、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、资产支持证券、债券逆回购等固定收益类资产和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资中小盘股票的资产不低于基金非现金资产的 80%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。比较财务报表的实际编制期间为 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

## (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权

定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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



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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的

股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	155,748,366.68	37,034,824.75
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	155,748,366.68	37,034,824.75

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	457,327,780.16	498,071,117.30	40,743,337.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	457,327,780.16	498,071,117.30	40,743,337.14
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	283,675,484.59	328,553,234.25	44,877,749.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	283,675,484.59	328,553,234.25	44,877,749.66

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	30,383.74	6,705.96
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,302.30	275.78
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	423.90	162.60
合计	35,109.94	7,144.34

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未及上年度末持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,270,428.75	495,035.03
银行间市场应付交易费用	-	1,200.00
合计	5,270,428.75	496,235.03

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	1,795.41	0.00
预提费用	310,000.00	535,000.00
合计	561,795.41	785,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	351,218,842.97	351,218,842.97
本期申购	475,013,196.07	475,013,196.07
本期赎回（以“-”号填列）	-552,905,632.04	-552,905,632.04
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	273,326,407.00	273,326,407.00

注：截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 154,326,950.00 份（2014 年 12 月 31 日：268,538,700.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 118,999,457.00 份（2014 年 12 月 31 日：82,680,142.97 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,242,428.40	-363,725.12	12,878,703.28
本期利润	275,611,059.00	-4,134,412.52	271,476,646.48
本期基金份额交易产生的变动数	16,502,451.84	43,148,620.07	59,651,071.91
其中：基金申购款	447,128,363.05	40,680,889.14	487,809,252.19
基金赎回款	-430,625,911.21	2,467,730.93	-428,158,180.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	305,355,939.24	38,650,482.43	344,006,421.67

## 7.4.7.11 存款利息收入

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4月10日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
活期存款利息收入	606,633.98	758,535.13
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	95,559.36	12,057.92
其他	10,389.23	6,092.18
合计	712,582.57	776,685.23

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金 合同生效日)至2014年12月 31日
卖出股票成交总额	8,299,804,342.92	1,869,089,017.02
减：卖出股票成本总额	7,998,057,127.84	1,777,382,415.31
买卖股票差价收入	301,747,215.08	91,706,601.71

## 7.4.7.13 债券投资收益

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4月10日(基金合 同生效日)至2014年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	-	315,235,876.67
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	-	309,104,336.57
减：应收利息总额	-	7,557,061.07
买卖债券差价收入	-	-1,425,520.97

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.16 股利收益

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4月10日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	439,047.65	5,291,774.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	439,047.65	5,291,774.67

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年4月10日(基金合同 生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,134,412.52	-39,174,696.16
——股票投资	-4,134,412.52	-40,550,504.73
——债券投资	-	1,375,808.57
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-4,134,412.52	-39,174,696.16

## 7.4.7.18 其他收入

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4月10日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
基金赎回费收入	5,856,991.46	6,544,553.65
合计	5,856,991.46	6,544,553.65

注：本基金场内部分的赎回费率为0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

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4月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	24,839,825.80	4,538,863.63
银行间市场交易费用	-	1,825.00
合计	24,839,825.80	4,540,688.63

## 7.4.7.20 其他费用

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4月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
审计费用	50,000.00	105,164.37
信息披露费	300,000.00	218,630.91
其他	600.00	-
上市年费	60,000.00	58,726.38
银行划款手续费	25,309.28	13,205.33
中债登债券托管账户维护费	27,000.00	4,500.00
合计	462,909.28	400,226.99

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构
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	基金管理人的子公司



际”)	
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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 4 月 10 日(基金合同生效日)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	-	0.00%	12,720,309.20	0.48%

###### 7.4.10.1.2 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
-	-	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 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	11,256.39	0.48%	-	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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,721,750.90	8,328,931.72
其中:支付销售机构的客户维护费	600,336.94	503.79

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,120,291.78	1,388,155.33

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 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 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
期初持有的基金份额	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	12,000,000.00	-

期末持有的基金份额	0.00	12,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	3.4200%

注：基金管理人大成基金在本年度赎回本基金的交易委托湘财证券办理，申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.10.4.2 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12月31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	2.2000%	6,000,000.00	1.7100%
广东证券	6,000,000.00	2.2000%	6,000,000.00	1.7100%

#### 7.4.10.5 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4月10日(基金合同生效日)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	155,748,366.68	606,633.98	37,034,824.75	758,535.13

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配事项。

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

## 7.4.12.1 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/增发证券而流通受限股票。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
600122	宏图高科	2015年12月25日	重大事项停牌	19.42	-	-	1,268,600	21,877,937.00	24,636,212.00	-
600990	四创电子	2015年8月31日	重大事项停牌	82.63	-	-	220,549	13,326,652.86	18,223,963.87	-
000796	凯撒旅游	2015年11月9日	重大事项停牌	29.59	-	-	525,350	14,035,209.22	15,545,106.50	-
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项停牌	56.68	-	-	195,900	10,927,062.00	11,103,612.00	-

注：本基金截至本报告期末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。

## 7.4.12.3 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

## 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以基金资产长期增值的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专

项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本

基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	155,748,366.68	-	-	-	155,748,366.68
结算备付金	9,560,660.51	-	-	-	9,560,660.51
存出保证金	942,126.32	-	-	-	942,126.32

交易性金融资产	-	-	-	498,071,117.30	498,071,117.30
应收利息	-	-	-	35,109.94	35,109.94
应收申购款	249,103.00	-	-	3,241,805.49	3,490,908.49
资产总计	166,500,256.51	-	-	501,348,032.73	667,848,289.24
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	42,642,705.92	42,642,705.92
应付赎回款	-	-	-	1,192,268.57	1,192,268.57
应付管理人报酬	-	-	-	727,081.64	727,081.64
应付托管费	-	-	-	121,180.28	121,180.28
应付交易费用	-	-	-	5,270,428.75	5,270,428.75
其他负债	-	-	-	561,795.41	561,795.41
负债总计	-	-	-	50,515,460.57	50,515,460.57
利率敏感度缺口	166,500,256.51	-	-	450,832,572.16	617,332,828.67
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,034,824.75	-	-	-	37,034,824.75
结算备付金	612,559.89	-	-	-	612,559.89
存出保证金	361,389.62	-	-	-	361,389.62
交易性金融资产	-	-	-	328,553,234.25	328,553,234.25
应收利息	-	-	-	7,144.34	7,144.34
资产总计	38,008,774.26	-	-	328,560,378.59	366,569,152.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	556.38	556.38
应付赎回款	-	-	-	475,198.14	475,198.14
应付管理人报酬	-	-	-	612,528.89	612,528.89
应付托管费	-	-	-	102,088.16	102,088.16
应付交易费用	-	-	-	496,235.03	496,235.03
其他负债	-	-	-	785,000.00	785,000.00
负债总计	-	-	-	2,471,606.60	2,471,606.60
利率敏感度缺口	38,008,774.26	-	-	326,088,771.99	364,097,546.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2014年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%；债券、资产支持证券、债券逆回购等固定收益类资产和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%；本基金投资中小盘股票的资产不低于基金非现金资产的80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	498,071,117.30	80.68	328,553,234.25	90.24
交易性金融资产—基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产—债券投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产—权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	498,071,117.30	80.68	328,553,234.25	90.24



## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2015年12月31日)	上年度末(2014年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	37,470,000.00	14,290,000.00
1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-37,470,000.00	-14,290,000.00	

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额 428,562,222.93 元,属于第二层次的余额为 69,508,894.37 元,无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日:第一层次 276,849,607.05 元,第二层次 51,703,627.20 元,无属于第三层次的余额)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2014 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	498,071,117.30	74.58
	其中：股票	498,071,117.30	74.58
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	165,309,027.19	24.75
	-	-	0.00
7	其他各项资产	4,468,144.75	0.67
8	合计	667,848,289.24	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	420,732,622.42	68.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,251,240.00	1.98
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	24,636,212.00	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	15,545,106.50	2.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,905,936.38	4.03
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	498,071,117.30	80.68

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300342	天银机电	1,045,763	48,105,098.00	7.79
2	300109	新开源	405,261	42,167,407.05	6.83
3	002662	京威股份	1,752,844	38,562,568.00	6.25
4	300078	思创医惠	621,308	30,319,830.40	4.91
5	600520	中发科技	916,900	25,563,172.00	4.14
6	002667	鞍重股份	341,400	25,536,720.00	4.14

7	002134	天津普林	1,362,829	25,212,336.50	4.08
8	002655	共达电声	1,010,955	24,930,150.30	4.04
9	300098	高新兴	1,186,562	24,905,936.38	4.03
10	600122	宏图高科	1,268,600	24,636,212.00	3.99
11	300263	隆华节能	838,700	24,238,430.00	3.93
12	000985	大庆华科	767,410	23,528,790.60	3.81
13	300196	长海股份	655,600	23,332,804.00	3.78
14	000333	美的集团	695,902	22,839,503.64	3.70
15	600990	四创电子	220,549	18,223,963.87	2.95
16	603318	派思股份	296,602	16,286,415.82	2.64
17	000796	凯撒旅游	525,350	15,545,106.50	2.52
18	000590	*ST 古汉	475,800	12,327,978.00	2.00
19	300332	天壕环境	502,100	12,251,240.00	1.98
20	300038	梅泰诺	195,900	11,103,612.00	1.80
21	603398	邦宝益智	91,472	8,453,842.24	1.37

#### 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	600661	新南洋	122,351,382.63	33.60
2	300078	思创医惠	121,100,670.99	33.26
3	601398	工商银行	101,709,893.24	27.93
4	603898	好莱客	93,812,809.19	25.77
5	000078	海王生物	91,693,348.89	25.18
6	000910	大亚科技	89,109,205.27	24.47
7	002366	台海核电	88,529,918.41	24.31
8	002009	天奇股份	86,966,364.13	23.89
9	600305	恒顺醋业	79,823,337.44	21.92
10	002711	欧浦智网	78,530,498.16	21.57
11	300075	数字政通	76,622,953.17	21.04
12	000938	紫光股份	74,281,130.63	20.40
13	600480	凌云股份	72,661,117.45	19.96
14	000333	美的集团	68,195,277.86	18.73
15	300109	新开源	66,706,418.20	18.32

16	600038	中直股份	66,187,652.65	18.18
17	002284	亚太股份	65,795,888.30	18.07
18	300053	欧比特	61,266,820.49	16.83
19	300016	北陆药业	61,167,432.59	16.80
20	300244	迪安诊断	60,351,761.64	16.58
21	300379	东方通	60,017,660.15	16.48
22	002127	新民科技	57,968,980.25	15.92
23	300465	高伟达	56,387,429.87	15.49
24	000796	凯撒旅游	54,615,598.83	15.00
25	002044	江苏三友	54,467,531.50	14.96
26	300049	福瑞股份	54,219,575.41	14.89
27	000810	创维数字	53,640,197.66	14.73
28	002363	隆基机械	53,272,290.18	14.63
29	002609	捷顺科技	52,861,628.06	14.52
30	002410	广联达	52,645,528.09	14.46
31	000733	振华科技	51,310,942.87	14.09
32	000802	北京文化	49,510,192.08	13.60
33	002230	科大讯飞	49,456,439.78	13.58
34	002251	步步高	48,701,944.67	13.38
35	600990	四创电子	48,405,819.23	13.29
36	300273	和佳股份	47,531,691.08	13.05
37	300284	苏交科	46,469,479.94	12.76
38	300012	华测检测	45,394,427.27	12.47
39	002599	盛通股份	44,175,455.95	12.13
40	002390	信邦制药	43,794,367.90	12.03
41	300011	鼎汉技术	43,575,363.56	11.97
42	600520	中发科技	43,269,000.51	11.88
43	002468	艾迪西	43,060,897.93	11.83
44	300369	绿盟科技	43,027,800.60	11.82
45	600048	保利地产	43,023,155.15	11.82
46	002439	启明星辰	42,607,477.60	11.70
47	600826	兰生股份	42,311,490.53	11.62
48	002612	朗姿股份	42,235,888.31	11.60
49	300352	北信源	42,186,964.89	11.59
50	300342	天银机电	42,175,258.10	11.58
51	600571	信雅达	41,902,354.13	11.51

52	002113	天润控股	40,695,490.40	11.18
53	600016	民生银行	40,674,737.91	11.17
54	002405	四维图新	39,559,630.19	10.87
55	300246	宝莱特	39,461,464.26	10.84
56	002665	首航节能	39,257,553.31	10.78
57	002290	禾盛新材	39,167,731.70	10.76
58	603023	威帝股份	38,928,069.10	10.69
59	300263	隆华节能	38,103,799.20	10.47
60	300182	捷成股份	38,064,347.19	10.45
61	300447	全信股份	37,888,412.48	10.41
62	300368	汇金股份	37,731,421.22	10.36
63	600684	珠江实业	37,174,247.98	10.21
64	000892	*ST 星美	36,828,158.64	10.11
65	600358	国旅联合	36,680,352.40	10.07
66	300165	天瑞仪器	36,447,969.58	10.01
67	002169	智光电气	36,419,221.47	10.00
68	300098	高新兴	35,996,979.56	9.89
69	300008	上海佳豪	35,900,821.57	9.86
70	000816	智慧农业	35,558,337.05	9.77
71	002662	京威股份	34,701,038.09	9.53
72	000524	岭南控股	34,515,661.60	9.48
73	601336	新华保险	33,660,874.65	9.25
74	000567	海德股份	33,349,072.76	9.16
75	300159	新研股份	32,986,624.54	9.06
76	300226	上海钢联	32,846,871.87	9.02
77	002402	和而泰	32,498,804.78	8.93
78	000701	厦门信达	32,062,204.31	8.81
79	000070	特发信息	31,889,998.22	8.76
80	002373	千方科技	31,881,477.25	8.76
81	300442	普丽盛	31,374,730.87	8.62
82	002364	中恒电气	31,210,501.25	8.57
83	002355	兴民钢圈	31,132,309.10	8.55
84	600198	大唐电信	31,052,533.66	8.53
85	603899	晨光文具	30,863,172.68	8.48
86	600576	万好万家	30,820,577.67	8.46
87	600713	南京医药	30,459,527.38	8.37

88	300031	宝通科技	30,120,000.00	8.27
89	000526	银润投资	30,072,774.46	8.26
90	002751	易尚展示	29,962,020.60	8.23
91	002343	禾欣股份	29,751,064.10	8.17
92	300458	全志科技	29,718,806.82	8.16
93	300339	润和软件	29,714,687.42	8.16
94	601599	鹿港科技	29,643,022.69	8.14
95	000566	海南海药	29,636,841.96	8.14
96	601939	建设银行	29,301,965.00	8.05
97	002104	恒宝股份	29,220,410.62	8.03
98	300250	初灵信息	29,075,870.00	7.99
99	300019	硅宝科技	28,684,815.77	7.88
100	300064	豫金刚石	28,359,212.17	7.79
101	002077	大港股份	28,306,732.74	7.77
102	002256	彩虹精化	28,230,193.31	7.75
103	002071	长城影视	28,225,281.25	7.75
104	002714	牧原股份	27,185,630.74	7.47
105	601688	华泰证券	27,180,321.27	7.47
106	000666	经纬纺机	27,130,539.26	7.45
107	300332	天壕环境	26,454,802.35	7.27
108	000673	当代东方	26,322,836.14	7.23
109	002049	同方国芯	25,979,758.17	7.14
110	600764	中电广通	25,716,927.60	7.06
111	002655	共达电声	25,576,892.75	7.02
112	002134	天津普林	25,512,338.33	7.01
113	600055	华润万东	24,903,267.74	6.84
114	600050	中国联通	24,564,880.00	6.75
115	300196	长海股份	24,523,285.64	6.74
116	002494	华斯股份	24,482,015.54	6.72
117	600343	航天动力	24,481,904.00	6.72
118	603088	宁波精达	24,334,945.75	6.68
119	600280	中央商场	24,294,440.00	6.67
120	002667	鞍重股份	24,112,756.23	6.62
121	300038	梅泰诺	24,020,218.01	6.60
122	000985	大庆华科	23,711,073.34	6.51
123	300347	泰格医药	23,660,740.31	6.50

124	300400	劲拓股份	23,379,088.57	6.42
125	002381	双箭股份	23,101,302.47	6.34
126	300115	长盈精密	22,962,921.76	6.31
127	600313	农发种业	22,407,765.12	6.15
128	600303	曙光股份	22,210,374.82	6.10
129	002055	得润电子	22,041,813.24	6.05
130	600122	宏图高科	21,877,937.00	6.01
131	002173	千足珍珠	21,872,902.55	6.01
132	002584	西陇科学	21,803,640.00	5.99
133	600683	京投银泰	21,501,793.91	5.91
134	002396	星网锐捷	21,469,185.20	5.90
135	600172	黄河旋风	21,396,124.87	5.88
136	600420	现代制药	21,366,115.75	5.87
137	300017	网宿科技	21,365,017.55	5.87
138	002548	金新农	21,319,058.82	5.86
139	300395	菲利华	21,308,744.59	5.85
140	601318	中国平安	21,181,772.00	5.82
141	600525	长园集团	21,153,261.87	5.81
142	300364	中文在线	21,067,006.71	5.79
143	600235	民丰特纸	20,987,682.80	5.76
144	002467	二六三	20,863,290.80	5.73
145	000695	滨海能源	20,842,360.00	5.72
146	000839	中信国安	20,816,702.88	5.72
147	002675	东诚药业	20,611,499.63	5.66
148	002345	潮宏基	20,571,247.60	5.65
149	300156	神雾环保	20,327,863.39	5.58
150	000997	新大陆	19,987,619.00	5.49
151	002707	众信旅游	19,820,163.72	5.44
152	002651	利君股份	19,753,313.51	5.43
153	002475	立讯精密	19,752,502.50	5.43
154	002116	中国海诚	19,545,465.55	5.37
155	000411	英特集团	19,471,956.84	5.35
156	300213	佳讯飞鸿	19,284,915.59	5.30
157	300366	创意信息	19,204,107.84	5.27
158	300018	中元华电	19,111,802.59	5.25
159	000687	华讯方舟	18,998,957.00	5.22



160	300236	上海新阳	18,791,616.99	5.16
161	000801	四川九洲	18,636,668.52	5.12
162	002516	旷达科技	18,527,042.24	5.09
163	000503	海虹控股	18,346,048.68	5.04
164	000002	万 科A	18,081,000.00	4.97
165	000881	大连国际	18,079,021.96	4.97
166	600873	梅花生物	17,805,420.03	4.89
167	300427	红相电力	17,424,604.00	4.79
168	601601	中国太保	17,286,284.00	4.75
169	300229	拓尔思	17,255,272.40	4.74
170	002565	上海绿新	16,771,849.54	4.61
171	300073	当升科技	16,631,879.03	4.57
172	002171	楚江新材	16,546,708.02	4.54
173	000049	德赛电池	16,384,495.74	4.50
174	600283	钱江水利	16,253,215.10	4.46
175	000024	招商地产	16,222,496.22	4.46
176	600083	博信股份	16,073,574.85	4.41
177	300043	互动娱乐	16,052,157.63	4.41
178	600476	湘邮科技	15,939,043.00	4.38
179	002246	北化股份	15,827,229.51	4.35
180	300329	海伦钢琴	15,802,725.20	4.34
181	300356	光一科技	15,763,084.00	4.33
182	000670	盈方微	15,726,476.59	4.32
183	300448	浩云科技	15,535,959.50	4.27
184	002572	索菲亚	15,386,702.78	4.23
185	000014	沙河股份	15,246,513.41	4.19
186	603108	润达医疗	15,245,490.02	4.19
187	000831	五矿稀土	15,222,481.55	4.18
188	002462	嘉事堂	15,219,895.64	4.18
189	603318	派思股份	15,189,739.64	4.17
190	600641	万业企业	15,104,790.00	4.15
191	300382	斯莱克	15,005,295.58	4.12
192	600547	山东黄金	14,952,571.45	4.11
193	300310	宜通世纪	14,947,013.00	4.11
194	300145	南方泵业	14,935,998.59	4.10
195	300390	天华超净	14,929,204.04	4.10

196	600596	新安股份	14,844,985.00	4.08
197	002253	川大智胜	14,794,901.10	4.06
198	600993	马应龙	14,711,311.34	4.04
199	002387	黑牛食品	14,691,404.39	4.04
200	002142	宁波银行	14,555,405.87	4.00
201	300239	东宝生物	14,513,996.54	3.99
202	002520	日发精机	14,476,304.70	3.98
203	000889	茂业通信	14,440,482.42	3.97
204	600036	招商银行	14,388,506.87	3.95
205	002183	怡亚通	14,345,512.02	3.94
206	600028	中国石化	14,300,304.00	3.93
207	300030	阳普医疗	14,195,056.29	3.90
208	600271	航天信息	14,133,967.04	3.88
209	002546	新联电子	14,048,691.04	3.86
210	002153	石基信息	14,002,578.69	3.85
211	002488	金固股份	14,001,461.00	3.85
212	300248	新开普	13,774,784.10	3.78
213	600958	东方证券	13,684,413.51	3.76
214	300455	康拓红外	13,663,205.00	3.75
215	000988	华工科技	13,638,905.32	3.75
216	300025	华星创业	13,611,313.85	3.74
217	000948	南天信息	13,600,345.35	3.74
218	600183	生益科技	13,584,509.88	3.73
219	300440	运达科技	13,577,168.20	3.73
220	002614	蒙发利	13,446,683.46	3.69
221	002717	岭南园林	13,442,707.90	3.69
222	000151	中成股份	13,355,541.00	3.67
223	002172	澳洋科技	13,316,197.30	3.66
224	002680	黄海机械	13,124,926.02	3.60
225	002338	奥普光电	13,024,925.97	3.58
226	002314	南山控股	12,978,300.54	3.56
227	002721	金一文化	12,937,049.00	3.55
228	002030	达安基因	12,796,790.04	3.51
229	000639	西王食品	12,713,311.82	3.49
230	300024	机器人	12,407,680.66	3.41
231	300096	易联众	12,152,050.00	3.34

232	300143	星河生物	12,147,175.76	3.34
233	002453	天马精化	12,109,552.60	3.33
234	000590	*ST 古汉	12,084,252.50	3.32
235	300205	天喻信息	11,956,912.60	3.28
236	002385	大北农	11,925,681.90	3.28
237	300147	香雪制药	11,914,939.66	3.27
238	000895	双汇发展	11,825,156.36	3.25
239	300230	永利股份	11,746,145.82	3.23
240	002085	万丰奥威	11,701,164.40	3.21
241	600060	海信电器	11,622,227.50	3.19
242	300302	同有科技	11,543,624.90	3.17
243	300166	东方国信	11,485,571.00	3.15
244	600682	南京新百	11,305,432.86	3.11
245	002303	美盈森	11,230,689.08	3.08
246	002688	金河生物	10,943,554.40	3.01
247	603030	全筑股份	10,918,064.00	3.00
248	002514	宝馨科技	10,903,585.60	2.99
249	600277	亿利能源	10,855,399.40	2.98
250	600783	鲁信创投	10,843,877.00	2.98
251	002224	三力士	10,835,288.08	2.98
252	300045	华力创通	10,725,398.99	2.95
253	002115	三维通信	10,641,775.08	2.92
254	000712	锦龙股份	10,612,942.69	2.91
255	000926	福星股份	10,601,247.00	2.91
256	600079	人福医药	10,584,142.02	2.91
257	002573	清新环境	10,407,414.81	2.86
258	000564	西安民生	10,278,970.47	2.82
259	600687	刚泰控股	10,167,564.80	2.79
260	002377	国创高新	10,166,305.72	2.79
261	000858	五粮液	10,127,073.00	2.78
262	601166	兴业银行	10,104,080.00	2.78
263	300095	华伍股份	9,956,945.00	2.73
264	300384	三联虹普	9,823,612.56	2.70
265	300037	新宙邦	9,446,669.50	2.59
266	600021	上海电力	9,227,431.76	2.53
267	300380	安硕信息	9,186,323.61	2.52

268	002268	卫 士 通	9,026,204.70	2.48
269	600287	江苏舜天	8,996,308.00	2.47
270	002080	中材科技	8,827,323.64	2.42
271	603398	邦宝益智	8,426,714.19	2.31
272	002188	新 嘉 联	8,363,547.99	2.30
273	600986	科达股份	8,328,910.00	2.29
274	000863	三湘股份	8,299,195.24	2.28
275	002249	大洋电机	8,299,151.76	2.28
276	300212	易华录	8,286,302.00	2.28
277	603001	奥康国际	8,255,910.44	2.27
278	600598	北大荒	8,255,408.00	2.27
279	601118	海南橡胶	8,253,816.64	2.27
280	002581	未名医药	8,154,328.56	2.24
281	000008	神州高铁	8,151,933.65	2.24
282	603111	康尼机电	8,045,730.22	2.21
283	000006	深振业A	8,013,735.09	2.20
284	600138	中青旅	7,852,387.50	2.16
285	600839	四川长虹	7,750,123.62	2.13
286	002496	辉丰股份	7,728,956.00	2.12
287	002594	比亚迪	7,640,628.74	2.10
288	300081	恒信移动	7,618,129.00	2.09
289	300041	回天新材	7,588,212.68	2.08
290	002235	安妮股份	7,477,609.90	2.05
291	000681	视觉中国	7,473,873.40	2.05
292	001696	宗申动力	7,471,378.00	2.05
293	300058	蓝色光标	7,436,879.72	2.04
294	600511	国药股份	7,430,021.60	2.04
295	600446	金证股份	7,396,545.19	2.03
296	600593	大连圣亚	7,384,479.94	2.03
297	002050	三花股份	7,382,433.00	2.03
298	300124	汇川技术	7,364,991.67	2.02
299	600643	爱建股份	7,360,180.65	2.02
300	300341	麦迪电气	7,357,845.38	2.02
301	002642	荣之联	7,355,568.09	2.02
302	300424	航新科技	7,328,376.10	2.01
303	002072	凯瑞德	7,314,359.00	2.01

304	300350	华鹏飞	7,288,417.96	2.00
305	300113	顺网科技	7,282,000.00	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。

#### 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	600661	新南洋	132,554,476.26	36.41
2	000078	海王生物	102,331,172.59	28.11
3	601398	工商银行	101,700,138.22	27.93
4	002366	台海核电	96,616,742.25	26.54
5	002009	天奇股份	94,684,549.21	26.01
6	300078	思创医惠	94,455,043.88	25.94
7	603898	好莱客	90,911,170.13	24.97
8	300075	数字政通	85,824,083.04	23.57
9	000938	紫光股份	85,250,659.40	23.41
10	000910	大亚科技	83,987,195.11	23.07
11	300011	鼎汉技术	80,701,534.00	22.16
12	002284	亚太股份	74,787,304.28	20.54
13	002711	欧浦智网	72,490,461.57	19.91
14	600480	凌云股份	69,287,046.33	19.03
15	600571	信雅达	68,607,169.79	18.84
16	300049	福瑞股份	67,955,821.35	18.66
17	300016	北陆药业	66,773,952.83	18.34
18	300379	东方通	65,603,798.24	18.02
19	300244	迪安诊断	64,000,510.69	17.58
20	600038	中直股份	63,117,269.38	17.34
21	300284	苏交科	62,539,856.28	17.18
22	600305	恒顺醋业	62,211,316.85	17.09
23	300465	高伟达	61,081,996.42	16.78
24	300053	欧比特	60,215,835.05	16.54
25	000810	创维数字	59,824,949.72	16.43
26	002609	捷顺科技	58,015,221.89	15.93
27	002230	科大讯飞	57,667,841.82	15.84
28	002410	广联达	57,406,386.25	15.77
29	002251	步步高	57,292,269.86	15.74
30	002127	新民科技	55,112,308.42	15.14

31	002044	江苏三友	54,443,571.88	14.95
32	002555	顺荣三七	53,742,111.86	14.76
33	002439	启明星辰	53,245,714.74	14.62
34	600055	华润万东	48,227,093.05	13.25
35	002390	信邦制药	47,961,459.05	13.17
36	002599	盛通股份	47,642,857.88	13.09
37	300368	汇金股份	46,868,629.53	12.87
38	000733	振华科技	46,599,631.59	12.80
39	000333	美的集团	46,423,486.12	12.75
40	300273	和佳股份	46,126,338.36	12.67
41	300012	华测检测	45,863,587.49	12.60
42	000802	北京文化	45,427,860.36	12.48
43	300008	上海佳豪	44,006,203.64	12.09
44	002113	天润控股	43,549,772.20	11.96
45	002355	兴民钢圈	43,549,608.33	11.96
46	600048	保利地产	42,643,259.33	11.71
47	002363	隆基机械	42,635,881.89	11.71
48	600826	兰生股份	41,956,818.34	11.52
49	300352	北信源	41,635,681.20	11.44
50	300447	全信股份	40,833,191.50	11.21
51	300109	新开源	40,202,353.64	11.04
52	000816	智慧农业	39,520,361.65	10.85
53	000892	*ST 星美	39,406,776.78	10.82
54	300369	绿盟科技	39,251,596.04	10.78
55	002405	四维图新	39,179,158.12	10.76
56	300182	捷成股份	39,037,110.55	10.72
57	000796	凯撒旅游	38,841,989.91	10.67
58	600990	四创电子	38,311,874.34	10.52
59	002290	禾盛新材	37,989,584.85	10.43
60	300246	宝莱特	37,443,306.00	10.28
61	600684	珠江实业	36,918,819.11	10.14
62	000566	海南海药	36,734,939.88	10.09
63	000567	海德股份	36,323,829.73	9.98
64	002612	朗姿股份	36,079,847.43	9.91
65	603023	威帝股份	35,743,589.62	9.82
66	600016	民生银行	35,611,671.31	9.78
67	300031	宝通科技	35,223,650.41	9.67
68	300165	天瑞仪器	35,069,770.46	9.63

69	300019	硅宝科技	34,994,341.05	9.61
70	300159	新研股份	34,956,436.10	9.60
71	000701	厦门信达	34,460,983.66	9.46
72	000070	特发信息	33,971,482.01	9.33
73	600358	国旅联合	33,369,011.40	9.16
74	601336	新华保险	33,135,438.90	9.10
75	300442	普丽盛	32,958,742.34	9.05
76	603899	晨光文具	32,517,456.90	8.93
77	300226	上海钢联	32,286,035.30	8.87
78	600198	大唐电信	32,151,729.43	8.83
79	002468	艾迪西	32,145,984.05	8.83
80	002665	首航节能	32,104,471.69	8.82
81	000526	银润投资	31,604,908.65	8.68
82	300236	上海新阳	31,342,396.00	8.61
83	002402	和而泰	31,268,272.10	8.59
84	601599	鹿港科技	31,239,563.69	8.58
85	600576	万好万家	31,207,517.61	8.57
86	002714	牧原股份	30,863,401.54	8.48
87	002343	禾欣股份	30,845,601.11	8.47
88	002364	中恒电气	30,465,566.18	8.37
89	002373	千方科技	29,795,572.85	8.18
90	601939	建设银行	29,107,461.15	7.99
91	002104	恒宝股份	29,081,653.60	7.99
92	002169	智光电气	28,543,640.04	7.84
93	300339	润和软件	28,266,309.75	7.76
94	300458	全志科技	28,221,731.04	7.75
95	600713	南京医药	27,939,778.55	7.67
96	300064	豫金刚石	27,772,333.32	7.63
97	002751	易尚展示	27,589,553.60	7.58
98	000524	岭南控股	27,219,319.72	7.48
99	000625	长安汽车	27,129,073.16	7.45
100	601688	华泰证券	26,486,443.92	7.27
101	600764	中电广通	26,379,773.10	7.25
102	300250	初灵信息	26,064,713.86	7.16
103	000666	经纬纺机	25,811,540.00	7.09
104	600280	中央商场	25,271,981.62	6.94
105	002071	长城影视	25,050,791.99	6.88
106	002256	彩虹精化	24,644,751.42	6.77

107	000673	当代东方	24,591,511.42	6.75
108	600303	曙光股份	24,548,160.63	6.74
109	600172	黄河旋风	24,523,284.70	6.74
110	600050	中国联通	24,322,468.44	6.68
111	300400	劲拓股份	24,075,502.96	6.61
112	002494	华斯股份	23,990,283.72	6.59
113	002179	中航光电	23,905,928.78	6.57
114	600313	农发种业	23,897,740.27	6.56
115	002381	双箭股份	23,831,788.43	6.55
116	002049	同方国芯	23,577,750.18	6.48
117	600277	亿利能源	23,439,831.13	6.44
118	000687	华讯方舟	23,106,886.85	6.35
119	300347	泰格医药	23,001,179.00	6.32
120	002077	大港股份	22,700,164.45	6.23
121	600340	华夏幸福	22,668,644.62	6.23
122	300395	菲利华	22,617,723.97	6.21
123	600525	长园集团	22,609,714.73	6.21
124	000997	新大陆	22,539,903.82	6.19
125	002675	东诚药业	22,137,701.86	6.08
126	300124	汇川技术	21,859,501.28	6.00
127	300364	中文在线	21,840,652.20	6.00
128	300017	网宿科技	21,695,190.03	5.96
129	600343	航天动力	21,596,597.40	5.93
130	002055	得润电子	21,536,422.40	5.92
131	000411	英特集团	21,457,600.03	5.89
132	002173	千足珍珠	21,162,313.18	5.81
133	603088	宁波精达	21,033,285.99	5.78
134	002345	潮宏基	21,027,072.78	5.78
135	300115	长盈精密	21,021,186.39	5.77
136	601318	中国平安	20,907,331.52	5.74
137	600683	京投银泰	20,825,929.61	5.72
138	600420	现代制药	20,716,972.08	5.69
139	002396	星网锐捷	20,634,467.22	5.67
140	002584	西陇科学	20,387,571.02	5.60
141	300131	英唐智控	20,333,753.22	5.58
142	300018	中元华电	20,317,340.84	5.58
143	002467	二六三	20,300,136.02	5.58
144	300366	创意信息	20,290,119.03	5.57



145	002721	金一文化	20,280,340.86	5.57
146	002462	嘉事堂	20,051,486.77	5.51
147	002614	蒙发利	20,028,047.60	5.50
148	300427	红相电力	19,958,212.00	5.48
149	002516	旷达科技	19,904,411.99	5.47
150	300382	斯莱克	19,803,994.52	5.44
151	600520	中发科技	19,776,943.82	5.43
152	002475	立讯精密	19,728,570.16	5.42
153	300229	拓尔思	19,505,967.05	5.36
154	000695	滨海能源	19,472,498.15	5.35
155	002651	利君股份	19,456,231.70	5.34
156	002707	众信旅游	19,444,282.18	5.34
157	600235	民丰特纸	19,307,642.34	5.30
158	300156	神雾环保	19,233,165.22	5.28
159	600476	湘邮科技	18,785,256.46	5.16
160	000839	中信国安	18,715,931.68	5.14
161	000503	海虹控股	18,619,278.72	5.11
162	300043	互动娱乐	18,619,210.88	5.11
163	600682	南京新百	18,365,791.12	5.04
164	000768	中航飞机	18,335,911.26	5.04
165	300213	佳讯飞鸿	18,302,132.25	5.03
166	000801	四川九洲	18,217,235.70	5.00
167	002548	金新农	18,196,616.50	5.00
168	000002	万科A	18,180,945.79	4.99
169	300239	东宝生物	18,070,933.69	4.96
170	000948	南天信息	17,928,624.15	4.92
171	300329	海伦钢琴	17,867,380.90	4.91
172	002292	奥飞动漫	17,720,057.36	4.87
173	600873	梅花生物	17,718,280.33	4.87
174	002116	中国海诚	17,447,193.70	4.79
175	002520	日发精机	17,361,254.58	4.77
176	600271	航天信息	17,213,469.66	4.73
177	601601	中国太保	17,066,298.60	4.69
178	002246	北化股份	17,022,634.00	4.68
179	000024	招商地产	16,703,769.00	4.59
180	000670	盈方微	16,639,309.60	4.57
181	000151	中成股份	16,568,683.34	4.55
182	002565	上海绿新	16,318,290.65	4.48

183	000881	大连国际	16,252,932.25	4.46
184	300310	宜通世纪	15,823,656.65	4.35
185	002253	川大智胜	15,734,140.52	4.32
186	300147	香雪制药	15,615,728.05	4.29
187	002572	索菲亚	15,507,279.64	4.26
188	600083	博信股份	15,466,682.00	4.25
189	000831	五矿稀土	15,432,630.81	4.24
190	002387	黑牛食品	15,417,840.79	4.23
191	300073	当升科技	15,375,043.27	4.22
192	002171	楚江新材	15,360,004.40	4.22
193	600641	万业企业	15,352,736.56	4.22
194	002314	南山控股	15,313,385.00	4.21
195	002142	宁波银行	15,305,972.34	4.20
196	600283	钱江水利	15,291,473.30	4.20
197	300356	光一科技	15,165,277.57	4.17
198	600547	山东黄金	15,061,326.00	4.14
199	600596	新安股份	15,032,560.06	4.13
200	603108	润达医疗	14,964,832.40	4.11
201	300448	浩云科技	14,899,719.83	4.09
202	300145	南方泵业	14,843,525.40	4.08
203	300332	天壕环境	14,819,577.00	4.07
204	002717	岭南园林	14,815,785.36	4.07
205	600183	生益科技	14,701,358.48	4.04
206	000049	德赛电池	14,691,824.04	4.04
207	002183	怡亚通	14,656,592.33	4.03
208	300263	隆华节能	14,582,009.11	4.00
209	600993	马应龙	14,334,220.82	3.94
210	000889	茂业通信	14,331,041.48	3.94
211	002680	黄海机械	14,296,825.36	3.93
212	300248	新开普	14,254,900.65	3.92
213	600036	招商银行	14,222,337.96	3.91
214	600958	东方证券	14,143,822.00	3.88
215	600028	中国石化	14,077,736.00	3.87
216	002488	金固股份	13,819,780.96	3.80
217	000988	华工科技	13,777,788.28	3.78
218	002153	石基信息	13,766,600.18	3.78
219	002030	达安基因	13,625,435.76	3.74
220	002610	爱康科技	13,588,876.87	3.73

221	300025	华星创业	13,551,695.80	3.72
222	300440	运达科技	13,515,473.80	3.71
223	300098	高新兴	13,408,161.51	3.68
224	300390	天华超净	13,396,521.60	3.68
225	300455	康拓红外	13,326,611.30	3.66
226	002546	新联电子	13,069,730.59	3.59
227	300038	梅泰诺	13,067,889.50	3.59
228	000639	西王食品	13,058,580.16	3.59
229	300007	汉威电子	13,057,086.58	3.59
230	002573	清新环境	12,781,709.76	3.51
231	002085	万丰奥威	12,600,638.00	3.46
232	600309	万华化学	12,441,493.31	3.42
233	300030	阳普医疗	12,415,889.47	3.41
234	002453	天马精化	12,381,533.88	3.40
235	300205	天喻信息	12,322,726.00	3.38
236	300024	机器人	12,269,002.56	3.37
237	300224	正海磁材	12,265,657.43	3.37
238	600060	海信电器	12,235,792.38	3.36
239	002172	澳洋科技	12,191,197.61	3.35
240	300070	碧水源	11,840,345.79	3.25
241	300315	掌趣科技	11,694,652.80	3.21
242	002224	三力士	11,673,394.62	3.21
243	600118	中国卫星	11,660,712.47	3.20
244	002385	大北农	11,651,180.66	3.20
245	002146	荣盛发展	11,519,717.25	3.16
246	000895	双汇发展	11,432,396.50	3.14
247	300302	同有科技	11,399,781.52	3.13
248	300096	易联众	11,356,681.00	3.12
249	300143	星河生物	11,165,060.68	3.07
250	600783	鲁信创投	11,120,517.00	3.05
251	300045	华力创通	11,033,421.10	3.03
252	000926	福星股份	10,992,352.84	3.02
253	002688	金河生物	10,867,532.00	2.98
254	000712	锦龙股份	10,780,970.00	2.96
255	002303	美盈森	10,745,835.79	2.95
256	603030	全筑股份	10,722,869.00	2.95
257	000006	深振业A	10,695,863.00	2.94
258	002338	奥普光电	10,668,290.51	2.93

259	600687	刚泰控股	10,637,548.78	2.92
260	002115	三维通信	10,528,200.23	2.89
261	600079	人福医药	10,523,248.08	2.89
262	002514	宝馨科技	10,456,728.28	2.87
263	000014	沙河股份	10,397,796.88	2.86
264	000564	西安民生	10,245,162.88	2.81
265	000858	五粮液	10,217,314.74	2.81
266	002268	卫士通	10,032,063.75	2.76
267	002377	国创高新	10,004,728.50	2.75
268	601166	兴业银行	9,821,068.00	2.70
269	300166	东方国信	9,647,747.17	2.65
270	002188	新嘉联	9,524,192.76	2.62
271	300380	安硕信息	9,387,241.00	2.58
272	600598	北大荒	9,345,967.72	2.57
273	300384	三联虹普	9,273,157.62	2.55
274	300037	新宙邦	9,233,458.80	2.54
275	600138	中青旅	9,188,019.07	2.52
276	002185	华天科技	9,054,400.88	2.49
277	300010	立思辰	9,053,641.17	2.49
278	300095	华伍股份	8,996,631.22	2.47
279	600021	上海电力	8,965,373.80	2.46
280	300350	华鹏飞	8,902,212.49	2.45
281	002050	三花股份	8,820,003.77	2.42
282	300230	永利股份	8,811,681.41	2.42
283	000008	神州高铁	8,780,031.52	2.41
284	002022	科华生物	8,660,837.90	2.38
285	600287	江苏舜天	8,646,392.67	2.37
286	300028	金亚科技	8,555,624.00	2.35
287	002103	广博股份	8,503,338.36	2.34
288	601118	海南橡胶	8,501,776.00	2.34
289	600986	科达股份	8,474,649.32	2.33
290	000681	视觉中国	8,442,024.39	2.32
291	000848	承德露露	8,283,541.39	2.28
292	002581	未名医药	8,276,895.50	2.27
293	603001	奥康国际	8,270,017.33	2.27
294	000863	三湘股份	8,199,938.60	2.25
295	300041	回天新材	8,056,995.84	2.21
296	002496	辉丰股份	8,011,215.66	2.20

297	002642	荣之联	7,986,824.41	2.19
298	603111	康尼机电	7,911,582.55	2.17
299	300324	旋极信息	7,877,728.25	2.16
300	600153	建发股份	7,838,077.36	2.15
301	600839	四川长虹	7,725,732.00	2.12
302	300113	顺网科技	7,712,223.00	2.12
303	001696	宗申动力	7,662,866.28	2.10
304	002594	比亚迪	7,651,539.84	2.10
305	300058	蓝色光标	7,648,873.63	2.10
306	002249	大洋电机	7,622,002.08	2.09
307	601021	春秋航空	7,621,998.20	2.09
308	002072	凯瑞德	7,477,379.48	2.05
309	300424	航新科技	7,476,267.88	2.05
310	600446	金证股份	7,470,441.81	2.05
311	300212	易华录	7,431,709.63	2.04
312	600593	大连圣亚	7,424,866.90	2.04
313	300220	金运激光	7,369,448.00	2.02
314	002368	太极股份	7,339,073.20	2.02

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	8,171,709,423.41
卖出股票收入（成交）总额	8,299,804,342.92

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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

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

**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	942,126.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,109.94
5	应收申购款	3,490,908.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,468,144.75

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600122	宏图高科	24,636,212.00	3.99	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
28,792	9,493.14	48,347,768.90	17.69%	224,978,638.10	82.31%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	25,985.39	0.0095%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	475,013,196.07
减：本报告期基金总赎回份额	552,905,632.04
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	273,326,407.00

## § 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、资产管理人于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、资产管理人于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、资产管理人于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、资产管理人于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、资产管理人于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、资产管理人分别于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, 无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 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。本年度支付的审计费用为 5 万元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
国海证券	1	11,961,754,302.86	11.91%	1,778,097.81	11.94%	-
申银万国	1	11,565,409,807.34	9.50%	1,412,157.55	9.48%	-
中金公司	2	1,301,294,351.52	7.90%	1,151,525.02	7.73%	-
中投证券	3	1,080,799,588.37	6.56%	995,742.96	6.69%	-
招商证券	2	1,072,221,925.21	6.51%	965,117.85	6.48%	-
国信证券	1	825,922,105.03	5.01%	751,405.18	5.05%	-
英大证券	1	773,980,909.13	4.70%	693,715.14	4.66%	-
国都证券	1	711,407,258.44	4.32%	644,811.62	4.33%	-
渤海证券	2	688,426,539.96	4.18%	611,386.83	4.11%	-
国泰君安	1	670,574,410.48	4.07%	611,101.34	4.10%	-
东方证券	1	615,725,986.08	3.74%	572,540.15	3.84%	-

齐鲁证券	2	507,095,415.34	3.08%	463,058.22	3.11%	-
财富证券	1	435,771,458.60	2.65%	385,619.19	2.59%	-
西南证券	1	363,753,465.89	2.21%	336,347.15	2.26%	-
华福证券	1	346,392,547.82	2.10%	322,595.59	2.17%	-
安信证券	2	330,541,962.42	2.01%	296,666.80	1.99%	-
华泰证券	2	320,456,743.69	1.95%	292,032.84	1.96%	-
东吴证券	1	314,900,092.89	1.91%	278,657.26	1.87%	-
长城证券	1	295,510,911.59	1.79%	261,502.16	1.76%	-
东莞证券	1	292,492,914.80	1.78%	266,555.04	1.79%	-
万联证券	1	275,093,942.98	1.67%	243,432.98	1.63%	-
万和证券	1	245,205,168.83	1.49%	225,014.61	1.51%	-
长江证券	1	236,915,731.21	1.44%	215,685.55	1.45%	-
广州证券	1	236,598,935.17	1.44%	215,399.52	1.45%	-
中航证券	1	204,533,521.31	1.24%	180,993.90	1.22%	-
中信证券	2	171,232,937.18	1.04%	158,817.97	1.07%	-
华鑫证券	1	156,748,898.41	0.95%	142,704.56	0.96%	-
民族证券	1	147,749,049.09	0.90%	130,745.31	0.88%	-
华宝证券	1	131,517,778.07	0.80%	116,380.41	0.78%	-
民生证券	1	89,387,998.18	0.54%	79,100.07	0.53%	-
广发证券	1	60,793,938.22	0.37%	55,346.16	0.37%	-
东海证券	1	41,303,170.22	0.25%	37,602.83	0.25%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；

(三) 研究实力较强, 能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

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

(五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

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

本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: 万和证券。

金额单位: 人民币元

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
1	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
2	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2015年第2期)-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/25
3	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2015年第2期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/25
4	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/4
5	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)2015年第3季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/24
6	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)2015年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
7	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)2015年半年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
8	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/24
9	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/24
10	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/24

11	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)2015 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/7/21
12	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)更新 招募说明书摘要(2015 年 1 期)	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/5/26
13	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)更新 招募说明书(2015 年 1 期)	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/5/26
14	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF) 2015 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/4/18
15	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)变更 基金经理公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/4/8
16	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)(原 景宏证券投资基金转型)2014 年年度报告摘 要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/28
17	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)(原 景宏证券投资基金转型)2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/28
18	大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/1/21
19	大成基金管理有限公司关于旗下基金股票估 值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/7/9
20	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/7/22
21	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/7/24
22	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/7/28
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/8/29
24	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/9/14
25	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/11/25
26	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基 金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/11/26
27	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的 “英唐智控”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/1/22
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的 “长安汽车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/13
29	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的 “顺荣三七”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/17
30	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的 “海虹控股”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/24
31	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的 “广联达”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2015/3/25

32	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“航天信息”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/26
33	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/16
34	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“丹甫股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/29
35	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华润万东”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/20
36	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“步步高”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/27
37	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金固股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/29
38	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“易联众”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/29
39	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“好莱客”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/16
40	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“江苏三友”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/20
41	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“海虹控股”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
42	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“朗姿股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
43	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“海王生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中恒电气”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
45	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中瑞思创”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
46	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“众信旅游”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/9
47	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“航天信息”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
48	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“迪安诊断”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
49	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“丹甫股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
50	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金固股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
51	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/11
52	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/7
53	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/13

54	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
55	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
56	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
57	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24
58	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/24
59	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/28
60	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/30
61	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
62	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/2
63	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
64	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
65	“大成上上签”活动获奖名单	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
66	大成基金电子直销交易系统维护通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
67	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/12
68	大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
69	大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
70	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
71	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/31
72	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
73	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/14

74	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/17
75	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/5
76	大成基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/5
77	关于大成基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/7
78	大成基金管理有限公司关于调整网上直销通联支付交易费率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
79	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/9
80	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/9
81	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/12
82	关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/15
83	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/16
84	大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/19
85	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/2
86	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/3
87	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/8
88	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/11
89	关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/24
90	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/27
91	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
92	大成基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
93	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10

94	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/27
95	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29
96	关于大成基金管理有限公司上海理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/13
97	大成基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/14
98	大成基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/22
99	大成基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/1
100	大成基金管理有限公司关于增加南京证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/12
101	大成基金管理有限公司关于增加南京证券有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/15
102	大成基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/17
103	大成基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
104	大成基金管理有限公司关于参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
105	大成基金管理有限公司关于增加上海银行股份有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/30
106	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/15
107	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/15
108	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/16
109	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
110	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
111	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/30
112	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/10
113	关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限	中国证监会指定报刊及	2015/11/16



	公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	本公司网站	
114	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/28
115	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/2
116	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/17
117	大成基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/18
118	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
119	大成基金管理有限公司关于网上直销系统暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
120	大成基金管理有限公司关于指数熔断机制对公司旗下公募基金相关业务事项影响的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）的文件；
- 2、《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 13.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人住所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 400-888-5558 (免长途通话费用)

国际互联网址: <http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司  
2016年3月26日