

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

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

大成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 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。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。

§ 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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 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

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

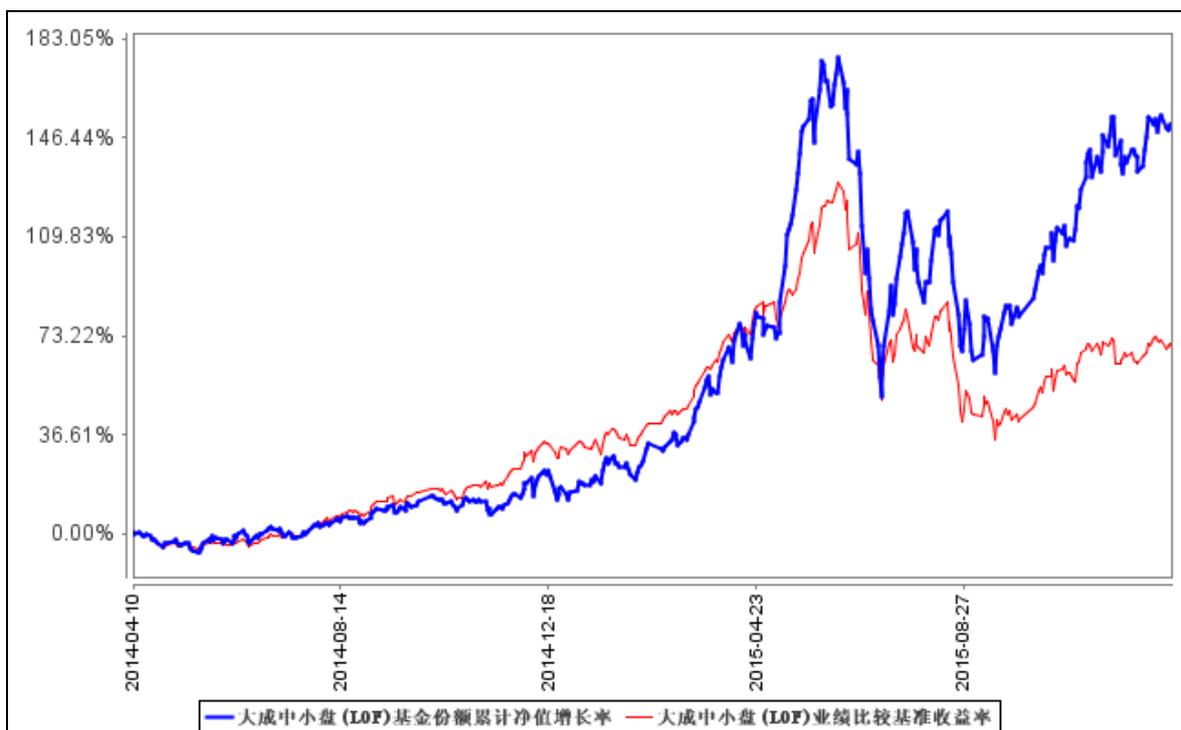
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

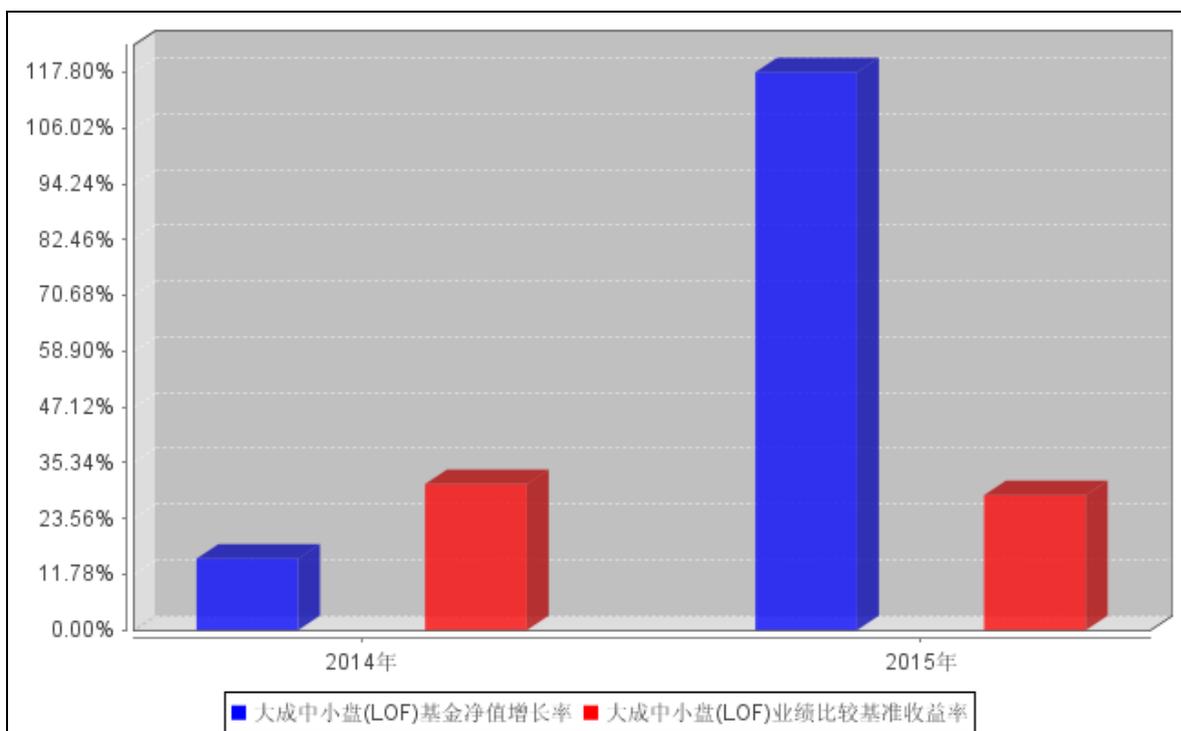
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	39.19%	2.22%	18.37%	1.61%	20.82%	0.61%
过去六个月	22.37%	3.32%	-11.20%	2.54%	33.57%	0.78%
过去一年	117.84%	3.03%	28.51%	2.23%	89.33%	0.80%
自基金合同生效起至今	150.78%	2.43%	68.13%	1.79%	82.65%	0.64%

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。
刘安田 安先生	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
侯春燕 春女士	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

	理				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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成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分配利润。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

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

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成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	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
资产总计	667,848,289.24	366,569,152.85
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债：		
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	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	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	561,795.41	785,000.00
负债合计	50,515,460.57	2,471,606.60
所有者权益：		

实收基金	273,326,407.00	351,218,842.97
未分配利润	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	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
一、收入	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	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	301,747,215.08	91,706,601.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-1,425,520.97
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	439,047.65	5,291,774.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	5,856,991.46	6,544,553.65
减：二、费用	33,144,777.76	14,658,002.67
1. 管理人报酬	6,721,750.90	8,328,931.72
2. 托管费	1,120,291.78	1,388,155.33
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	462,909.28	400,226.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	271,476,646.48	49,223,575.76

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	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

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。

7.4.4 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(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 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%
------	---	-------	---------------	-------

7.4.5.1.2 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。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 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。

7.4.5.2.2 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	1,120,291.78	1,388,155.33

的托管费		
------	--	--

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。

7.4.5.3 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。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	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。

7.4.5.4.2 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		上年度末	
	2015年12月31日		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	6,000,000.00	2.2000%	6,000,000.00	1.7100%

证券				
----	--	--	--	--

7.4.5.5 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。

7.4.5.6 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。

7.4.5.7 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。

7.4.6 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	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	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

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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	1,961,754,302.86	11.91%	1,778,097.81	11.94%	-
申银万国	1	1,565,409,807.34	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

§ 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。

大成基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日