

大成行业轮动混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

大成行业轮动股票型证券投资基金经中国证监会证监许可[2009]664 号文核准募集，基金合同于 2009 年 9 月 8 日起生效。自基金合同生效以来本基金运作平稳。根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》有关规定，经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 3 日起本基金名称变更为“大成行业轮动混合型证券投资基金”；基金简称变更为“大成行业轮动混合”；基金类别变更为“混合型”。基金代码保持不变，仍为 090009。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，《大成行业轮动股票型证券投资基金基金合同》、《大成行业轮动股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成行业轮动混合型证券投资基金承担和继承。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成行业轮动混合
基金主代码	090009
交易代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 8 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	124, 286, 132. 92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用行业轮动效应，优化行业配置，获取超额投资收益，实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉行业轮动效应下的投资机会，自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类别间的战术配置，精选优质行业的优质股票，获取超额投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部
------------	--

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	10,951,068.68	46,890,028.25	30,836,583.24
本期利润	-3,533,391.08	60,474,404.52	10,520,209.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0249	0.2394	0.0290
本期基金份额净值增长率	29.46%	35.70%	3.54%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3110	0.1098	-0.1820
期末基金资产净值	178,553,719.73	205,808,882.93	265,786,702.98
期末基金份额净值	1.437	1.110	0.818

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。

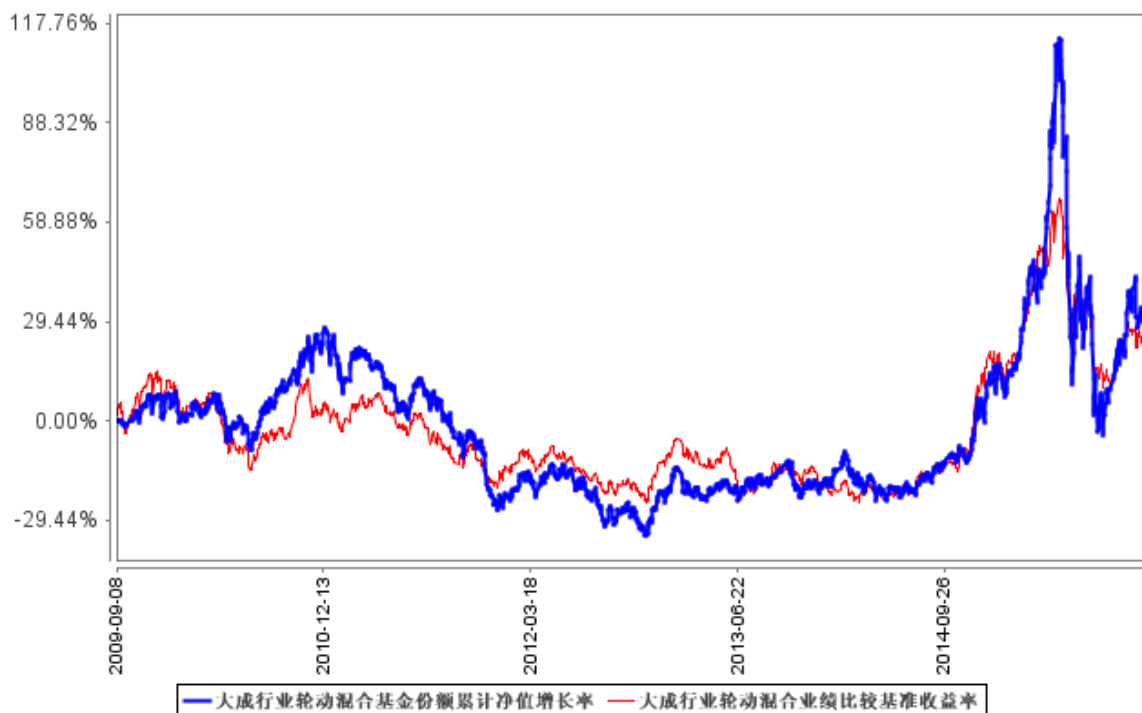
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

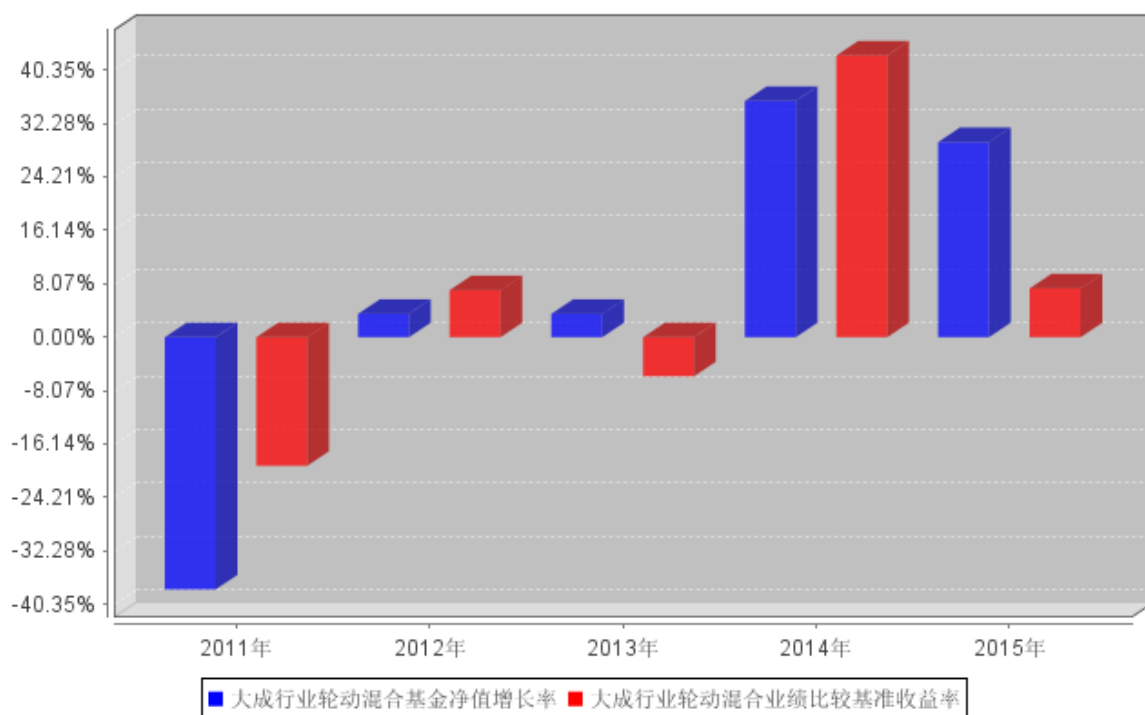
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	30.76%	2.29%	13.68%	1.34%	17.08%	0.95%
过去六个月	-3.88%	3.59%	-12.06%	2.14%	8.18%	1.45%
过去一年	29.46%	3.21%	7.37%	1.99%	22.09%	1.22%
过去三年	81.90%	2.12%	44.05%	1.43%	37.85%	0.69%
过去五年	16.55%	1.85%	24.28%	1.29%	-7.73%	0.56%
自基金合同生效起至今	43.70%	1.75%	26.62%	1.29%	17.08%	0.46%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年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

本基金在过去三年未进行利润分配。

§ 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		
支兆华先生	本基金基金经理	2015年5月23日	2015年12月13日	14年	经济学硕士。2001年至2005年,在华夏基金管理有限公司从事产品开发工作。2006年加入大成基金管理有限公司,历任规划发展部总监助理、副总监、总经理办公室主任兼公司战略发展委员会秘书、数量投资部总监及研究部总监。2013年11月25日至2015年12月8日任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。2015年5月23日至2015年7月2日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2015年7月3日至2015年12月13日任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
王磊先生	本基金基金经理	2015年12月14日	-	12年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部

					<p>投资经理及总监（主持工作）。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日至2015年7月15日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015年7月16日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年7月17日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起兼任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014年12月9日起任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2015年12月14日起任大成行业轮动混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
徐雄晖先生	本基金基金经理	2013年4月8日	2015年5月22日	7年	<p>经济学硕士，2008年加入大成基金管理有限公司，曾任研究员、社会服务行业研究主管，2010年2月25日至2013年3月11日担任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理助理及大成核心双动力证券投资基金基金经理助理。2013年4月8日至2015年5月22日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2014年5月29日至2015年5月22日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中</p>

					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》、《大成行业轮动混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成行业轮动混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 130 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，股票市场出现了较大波动。在上半年，一系列的因素导致大量资金进入股票市场，使上半年股票市场出现快速上涨。这些因素主要包括：货币政策持续宽松，国家为了经济转型的需要也大力支持改革创新，部分上市公司进行兼并重组，两融业务出现快速增长和杠杆资金的大量运用。在这些因素中，杠杆资金是推动股市上涨的重要力量，但其隐藏的杀伤力同样巨大。在 8 月份，由于监管机构开始清查违规资金入市，导致杠杆资金的连续杀跌，并形成连锁效应，导致市场出现了快速的无量下跌，部分交易日市场几乎整体跌停。为了避免整体的金融风险，维持证券市场稳定，国家进行了积极的干预政策，使市场趋于稳定，市场在 9 月份开始出现反弹，年底大致收盘于股灾发生前位置。市场虽然全年仍然取得正收益，但波动剧烈，操作难度较大。本产品在上半年增加了仓位，获得部分收益，但在 8 月份急剧下跌中，由于市场几乎没有成交量，导致产品净值出现损失。在市场趋稳之后，本产品适当增加了权益仓位，产品净值有所回升。由于本产品在 2015 年的投资方向主要为中小市值股票，业绩表现超越了比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.437 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.46%，同期业绩比较基准收益率为 7.37%，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

2016 年，我们认为，主导市场的因素更加复杂多变。一是宏观经济形式仍然较弱，短期内难言触底回升，二是货币政策虽然仍将保持适度宽松，但其力度要弱于 2015 年。同时，国际经济形势，特别是美国的经济走势和美元走势以及其对于人民币汇率的影响，也是需要考虑的重要因素。综合考虑，我们认为，2016 年的市场仍将维持一定波动，但向下的空间较为有限。我们将根据市

场的情况，主动积极的做好仓位控制和个股选择，争取获得较好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成行业轮动混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成行业轮动混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金 2015 年年度财务报表已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

资产：		
银行存款	18,044,523.55	12,293,227.60
结算备付金	1,671,693.89	1,433,377.43
存出保证金	509,620.79	139,839.79
交易性金融资产	160,780,832.12	192,859,288.02
其中：股票投资	160,651,332.12	142,341,688.02
基金投资	-	-
债券投资	129,500.00	50,517,600.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,795,300.40	1,782,853.49
应收利息	4,403.58	28,784.16
应收股利	-	-
应收申购款	864,707.07	186,915.91
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	183,671,081.40	208,724,286.40
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	3,587,772.85	153,847.71
应付赎回款	401,550.24	1,302,915.08
应付管理人报酬	217,068.10	253,254.12
应付托管费	36,178.01	42,209.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	724,050.47	793,071.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,742.00	370,105.76
负债合计	5,117,361.67	2,915,403.47
所有者权益：		
实收基金	124,286,132.92	185,444,534.71
未分配利润	54,267,586.81	20,364,348.22
所有者权益合计	178,553,719.73	205,808,882.93
负债和所有者权益总计	183,671,081.40	208,724,286.40

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.437 元，基金份额总额 124,286,132.92 份。

7.2 利润表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	4,724,968.27	67,338,276.24
1. 利息收入	232,077.61	254,402.59
其中：存款利息收入	210,558.55	246,424.51
债券利息收入	21,519.06	7,978.08
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）	18,691,420.44	53,481,969.32
其中：股票投资收益	16,999,357.96	51,074,697.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,547,863.20	197,860.89
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	144,199.28	2,209,410.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-14,484,459.76	13,584,376.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	285,929.98	17,528.06
减：二、费用	8,258,359.35	6,863,871.72
1. 管理人报酬	2,843,973.00	3,225,550.24
2. 托管费	473,995.48	537,591.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,557,462.09	2,696,408.49
5. 利息支出	-	7,115.73
其中：卖出回购金融资产支出	-	7,115.73
6. 其他费用	382,928.78	397,205.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,533,391.08	60,474,404.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,533,391.08	60,474,404.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	185,444,534.71	20,364,348.22	205,808,882.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,533,391.08	-3,533,391.08
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）	-61,158,401.79	37,436,629.67	-23,721,772.12
其中：1. 基金申购款	201,907,287.85	161,436,003.42	363,343,291.27
2. 基金赎回款	-263,065,689.64	-123,999,373.75	-387,065,063.39
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）	124,286,132.92	54,267,586.81	178,553,719.73
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	324,920,726.90	-59,134,023.92	265,786,702.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,474,404.52	60,474,404.52
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）	-139,476,192.19	19,023,967.62	-120,452,224.57
其中：1. 基金申购款	19,421,337.75	-1,627,331.89	17,794,005.86
2. 基金赎回款	-158,897,529.94	20,651,299.51	-138,246,230.43
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）	185,444,534.71	20,364,348.22	205,808,882.93

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.1 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、可交换债券、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。

7.4.1.2 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。

7.4.2 税项

7.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰；由出让方缴纳。

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

7.4.2.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

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

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

7.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

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

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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	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	259,697,308.43	8.58%	109,874,951.29	6.33%

7.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
光大证券	-	0.00%	20,616,335.50	43.18%

7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
光大证券	-	0.00%	13,000,000.00	100.00%

7.4.4.1.4 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	237,535.58	8.71%	149,272.26	20.62%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	97,888.81	6.29%	23,524.06	2.97%

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,843,973.00	3,225,550.24
其中：支付销售机构的客户维护费	691,514.27	720,941.49

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2015 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 217,068.10 元（2014 年 12 月 31 日：人民币 253,254.12 元）。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	473,995.48	537,591.74

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 于 2015 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 36,178.01 元（2014 年 12 月 31 日：人民

币 42,209.03 元)。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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1月1日至2014年12月31日
期初持有的基金份额	-	53,000,000.00
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	-	53,000,000.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.000%	0.000%

注：基金管理人赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	18,044,523.55	184,453.24	12,293,227.60	235,723.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 18 日	2016 年 1 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	1,295.00	129,500.00	129,500.00	-

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000599	青岛双星	2015 年 12 月 29 日	重大事件	9.96	2016 年 1 月 19 日	8.96	381,900	3,534,005.00	3,803,724.00	-
300011	鼎汉技术	2015 年 12 月 31 日	重大事件	29.80	2016 年 1 月 22 日	26.82	33,134	914,906.91	987,393.20	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	160,651,332.12	87.47
	其中：股票	160,651,332.12	87.47
2	固定收益投资	129,500.00	0.07
	其中：债券	129,500.00	0.07
	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	19,716,217.44	10.73
7	其他各项资产	3,174,031.84	1.73
8	合计	183,671,081.40	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	102,290,476.88	57.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	18,685.00	0.01
F	批发和零售业	11,838,665.84	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,894,812.06	1.06
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,185,776.99	14.11
J	金融业	5,917,065.00	3.31
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	8,100,343.35	4.54

M	科学研究和技术服务业	3,447,243.00	1.93
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	1,958,264.00	1.10
S	综合	-	0.00
	合计	160,651,332.12	89.97

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	002662	京威股份	432,200	9,508,400.00	5.33
2	300059	东方财富	157,064	8,172,039.92	4.58
3	600303	曙光股份	504,000	7,736,400.00	4.33
4	600520	中发科技	273,800	7,633,544.00	4.28
5	002517	泰亚股份	118,699	7,186,037.46	4.02
6	002355	兴民钢圈	338,928	6,798,895.68	3.81
7	002730	电光科技	134,200	6,594,588.00	3.69
8	300298	三诺生物	179,698	6,461,940.08	3.62
9	002292	奥飞动漫	124,555	6,440,739.05	3.61
10	000001	平安银行	493,500	5,917,065.00	3.31

注：投资者欲了解本报告期末基金指数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	600038	中直股份	37,146,679.21	18.05
2	002364	中恒电气	36,895,589.66	17.93
3	600998	九州通	34,405,572.86	16.72
4	300212	易华录	33,818,692.77	16.43
5	300348	长亮科技	33,780,273.00	16.41
6	300332	天壕环境	32,345,241.31	15.72
7	000997	新大陆	26,292,560.89	12.78
8	002702	海欣食品	26,041,339.61	12.65
9	600885	宏发股份	25,622,026.06	12.45
10	002301	齐心集团	25,498,818.55	12.39
11	002029	七匹狼	25,205,513.10	12.25
12	300096	易联众	20,766,891.20	10.09
13	300400	劲拓股份	18,502,461.33	8.99
14	300059	东方财富	18,100,500.55	8.79
15	002547	春兴精工	18,071,687.53	8.78
16	002331	皖通科技	16,921,156.33	8.22
17	601601	中国太保	16,471,631.45	8.00
18	600057	象屿股份	15,822,838.05	7.69
19	000651	格力电器	15,379,076.00	7.47
20	002740	爱迪尔	15,126,703.89	7.35
21	002044	江苏三友	15,011,313.85	7.29
22	300057	万顺股份	14,383,439.00	6.99
23	300353	东土科技	14,274,260.52	6.94
24	300139	晓程科技	14,174,165.59	6.89
25	600880	博瑞传播	14,112,924.43	6.86
26	601939	建设银行	13,720,509.78	6.67
27	000612	焦作万方	13,683,823.73	6.65
28	600759	洲际油气	13,405,549.53	6.51
29	002115	三维通信	13,277,575.32	6.45
30	300284	苏交科	12,998,216.56	6.32
31	601318	中国平安	12,985,536.54	6.31
32	002410	广联达	12,843,431.49	6.24
33	002074	国轩高科	12,661,404.73	6.15
34	600340	华夏幸福	12,635,115.10	6.14
35	601058	赛轮金宇	12,529,309.10	6.09
36	600592	龙溪股份	11,631,724.50	5.65

37	000712	锦龙股份	11,470,226.16	5.57
38	300458	全志科技	11,038,145.00	5.36
39	300124	汇川技术	10,945,692.37	5.32
40	002580	圣阳股份	10,834,983.18	5.26
41	300133	华策影视	10,803,184.72	5.25
42	002292	奥飞动漫	10,533,297.85	5.12
43	601555	东吴证券	10,186,074.27	4.95
44	300016	北陆药业	10,038,267.00	4.88
45	300028	金亚科技	10,020,834.60	4.87
46	000415	渤海租赁	9,913,937.00	4.82
47	300299	富春通信	9,899,149.00	4.81
48	300166	东方国信	9,709,827.74	4.72
49	300183	东软载波	9,409,009.95	4.57
50	300017	网宿科技	9,386,357.05	4.56
51	600079	人福医药	9,252,922.01	4.50
52	002288	超华科技	9,249,794.66	4.49
53	002261	拓维信息	9,160,632.05	4.45
54	002662	京威股份	9,138,466.50	4.44
55	600570	恒生电子	8,865,500.00	4.31
56	600303	曙光股份	8,732,929.00	4.24
57	600358	国旅联合	8,598,953.92	4.18
58	002517	泰亚股份	8,291,496.30	4.03
59	000816	智慧农业	8,163,893.00	3.97
60	300363	博腾股份	8,137,417.65	3.95
61	002039	黔源电力	7,979,115.70	3.88
62	002179	中航光电	7,930,867.27	3.85
63	600520	中发科技	7,922,290.00	3.85
64	002152	广电运通	7,750,258.36	3.77
65	300203	聚光科技	7,728,121.62	3.75
66	000599	青岛双星	7,529,537.00	3.66
67	300045	华力创通	7,438,749.88	3.61
68	002661	克明面业	7,217,624.53	3.51
69	000728	国元证券	7,089,952.87	3.44
70	300298	三诺生物	6,834,574.71	3.32
71	300395	菲利华	6,332,484.19	3.08
72	600410	华胜天成	6,267,648.00	3.05

73	002730	电光科技	6,253,361.52	3.04
74	000800	一汽轿车	6,233,227.14	3.03
75	300058	蓝色光标	6,230,749.52	3.03
76	300292	吴通控股	6,205,120.49	3.01
77	300208	恒顺众昇	6,162,139.09	2.99
78	002230	科大讯飞	6,146,947.46	2.99
79	000567	海德股份	6,143,542.20	2.99
80	000001	平安银行	6,105,107.00	2.97
81	002355	兴民钢圈	6,083,140.00	2.96
82	002024	苏宁云商	6,010,248.00	2.92
83	600683	京投银泰	5,919,395.03	2.88
84	300250	初灵信息	5,905,288.80	2.87
85	603601	再升科技	5,786,427.00	2.81
86	600005	武钢股份	5,685,547.00	2.76
87	600769	祥龙电业	5,395,095.42	2.62
88	000638	万方发展	5,252,603.92	2.55
89	600382	广东明珠	5,208,985.00	2.53
90	300112	万讯自控	5,163,480.00	2.51
91	600146	大元股份	5,148,723.00	2.50
92	002071	长城影视	5,139,124.00	2.50
93	600029	南方航空	4,998,477.00	2.43
94	300178	腾邦国际	4,973,069.50	2.42
95	601628	中国人寿	4,899,166.00	2.38
96	601336	新华保险	4,877,412.26	2.37
97	002477	雏鹰农牧	4,856,646.82	2.36
98	002245	澳洋顺昌	4,764,112.61	2.31
99	600418	江淮汽车	4,622,400.00	2.25
100	000839	中信国安	4,390,399.72	2.13
101	600332	白云山	4,356,902.59	2.12
102	002654	万润科技	4,315,123.00	2.10
103	600586	金晶科技	4,268,934.00	2.07
104	002108	沧州明珠	4,252,447.39	2.07
105	603898	好莱客	4,202,989.40	2.04
106	300218	安利股份	4,199,623.50	2.04
107	600290	华仪电气	4,184,791.00	2.03
108	300258	精锻科技	4,177,530.15	2.03

109	002531	天顺风能	4,169,977.00	2.03
-----	--------	------	--------------	------

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	002301	齐心集团	35,967,788.43	17.48
2	601318	中国平安	31,097,185.70	15.11
3	002029	七匹狼	28,269,642.72	13.74
4	300212	易华录	26,620,012.03	12.93
5	600038	中直股份	26,251,133.80	12.76
6	600885	宏发股份	24,515,608.22	11.91
7	600998	九州通	24,338,360.79	11.83
8	300332	天壕环境	23,170,392.21	11.26
9	002364	中恒电气	21,978,504.32	10.68
10	300353	东土科技	21,936,015.75	10.66
11	300348	长亮科技	21,164,959.50	10.28
12	300096	易联众	20,884,506.99	10.15
13	600707	彩虹股份	19,211,031.22	9.33
14	002547	春兴精工	18,675,460.58	9.07
15	300139	晓程科技	17,738,218.93	8.62
16	601988	中国银行	17,687,708.00	8.59
17	002702	海欣食品	17,459,521.64	8.48
18	300400	劲拓股份	17,409,670.04	8.46
19	601601	中国太保	17,172,087.68	8.34
20	000651	格力电器	16,137,321.53	7.84
21	600759	洲际油气	15,489,728.70	7.53
22	600057	象屿股份	15,449,402.56	7.51
23	600079	人福医药	14,620,936.61	7.10
24	300166	东方国信	14,593,777.23	7.09
25	601398	工商银行	14,506,159.00	7.05
26	600361	华联综超	14,425,068.82	7.01
27	002508	老板电器	14,418,933.67	7.01
28	002115	三维通信	14,047,531.74	6.83
29	300458	全志科技	13,876,555.00	6.74
30	000997	新大陆	13,755,075.24	6.68
31	002580	圣阳股份	13,673,281.53	6.64

32	000848	承德露露	13,617,403.90	6.62
33	000712	锦龙股份	13,381,417.83	6.50
34	601939	建设银行	13,316,481.90	6.47
35	002074	国轩高科	13,215,644.54	6.42
36	002044	江苏三友	13,152,626.40	6.39
37	601058	赛轮金宇	12,806,540.00	6.22
38	000026	飞亚达A	12,708,409.06	6.17
39	300057	万顺股份	12,348,615.99	6.00
40	002410	广联达	12,314,059.02	5.98
41	600340	华夏幸福	12,264,677.56	5.96
42	300183	东软载波	12,218,839.40	5.94
43	600880	博瑞传播	12,043,174.63	5.85
44	300045	华力创通	11,984,626.41	5.82
45	300124	汇川技术	11,733,508.18	5.70
46	300284	苏交科	11,593,455.27	5.63
47	002292	奥飞动漫	11,529,523.23	5.60
48	300133	华策影视	11,351,865.56	5.52
49	000612	焦作万方	11,343,228.59	5.51
50	000816	智慧农业	11,169,428.50	5.43
51	002179	中航光电	10,739,016.74	5.22
52	002331	皖通科技	10,696,849.39	5.20
53	300017	网宿科技	10,582,356.00	5.14
54	002288	超华科技	9,888,138.94	4.80
55	601628	中国人寿	9,870,781.69	4.80
56	600358	国旅联合	9,746,628.05	4.74
57	601555	东吴证券	9,705,922.54	4.72
58	300208	恒顺众昇	9,478,319.82	4.61
59	600570	恒生电子	9,478,110.88	4.61
60	300059	东方财富	9,417,982.15	4.58
61	002740	爱迪尔	9,160,194.80	4.45
62	000415	渤海租赁	9,121,982.00	4.43
63	300203	聚光科技	9,116,606.65	4.43
64	600592	龙溪股份	9,092,177.41	4.42
65	002152	广电运通	8,967,507.31	4.36
66	002261	拓维信息	8,667,328.00	4.21
67	300028	金亚科技	8,586,257.80	4.17
68	002039	黔源电力	7,902,838.49	3.84
69	300299	富春通信	7,866,612.00	3.82

70	000728	国元证券	7,738,937.84	3.76
71	000567	海德股份	7,397,562.00	3.59
72	300016	北陆药业	7,042,874.58	3.42
73	300250	初灵信息	6,763,677.62	3.29
74	002661	克明面业	6,649,427.40	3.23
75	300363	博腾股份	6,631,387.37	3.22
76	600683	京投银泰	6,535,340.86	3.18
77	300292	吴通控股	6,505,147.72	3.16
78	600410	华胜天成	6,486,889.10	3.15
79	000800	一汽轿车	6,393,259.61	3.11
80	600769	祥龙电业	6,232,256.41	3.03
81	000776	广发证券	6,176,341.44	3.00
82	300171	东富龙	5,966,773.00	2.90
83	002230	科大讯飞	5,843,311.89	2.84
84	002024	苏宁云商	5,662,667.03	2.75
85	601166	兴业银行	5,559,250.00	2.70
86	000810	创维数字	5,489,817.04	2.67
87	600000	浦发银行	5,408,637.31	2.63
88	002071	长城影视	5,399,433.62	2.62
89	600029	南方航空	5,358,177.49	2.60
90	600382	广东明珠	5,275,986.02	2.56
91	002477	雏鹰农牧	5,234,109.06	2.54
92	600005	武钢股份	5,212,164.00	2.53
93	300112	万讯自控	5,074,401.28	2.47
94	600282	南钢股份	4,990,344.00	2.42
95	601336	新华保险	4,986,064.20	2.42
96	002251	步步高	4,851,000.00	2.36
97	603898	好莱客	4,817,253.21	2.34
98	603111	康尼机电	4,812,711.01	2.34
99	600146	大元股份	4,792,422.96	2.33
100	002108	沧州明珠	4,699,084.72	2.28
101	000599	青岛双星	4,633,955.00	2.25
102	600418	江淮汽车	4,615,511.01	2.24
103	600586	金晶科技	4,472,346.10	2.17
104	000666	经纬纺机	4,436,908.86	2.16
105	600767	运盛实业	4,427,612.00	2.15
106	300258	精锻科技	4,355,064.05	2.12
107	600138	中青旅	4,349,015.78	2.11

108	002344	海宁皮城	4,334,343.00	2.11
109	600060	海信电器	4,332,740.00	2.11
110	002355	兴民钢圈	4,332,335.64	2.11
111	300218	安利股份	4,311,752.32	2.10
112	002170	芭田股份	4,307,303.62	2.09
113	002322	理工监测	4,304,099.12	2.09
114	002258	利尔化学	4,296,667.10	2.09
115	600332	白云山	4,290,088.25	2.08
116	600143	金发科技	4,255,229.50	2.07
117	300395	菲利华	4,246,822.52	2.06
118	600525	长园集团	4,243,299.91	2.06
119	600030	中信证券	4,215,448.00	2.05
120	002531	天顺风能	4,184,406.00	2.03
121	002048	宁波华翔	4,183,168.78	2.03
122	300223	北京君正	4,180,996.58	2.03

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	1,520,575,913.05
卖出股票收入（成交）总额	1,510,943,471.62

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	129,500.00	0.07
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	129,500.00	0.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	1,295	129,500.00	0.07

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投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,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	509,620.79
2	应收证券清算款	1,795,300.40
3	应收股利	-
4	应收利息	4,403.58
5	应收申购款	864,707.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,174,031.84

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
11,600	10,714.32	1,981,134.91	1.59%	122,304,998.01	98.41%

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	71,135.40	0.057%

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、基金投资和相关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（2009年9月8日）基金份额总额	3,086,196,884.20
本报告期期初基金份额总额	185,444,534.71
本报告期基金总申购份额	201,907,287.85
减：本报告期基金总赎回份额	263,065,689.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	124,286,132.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于2015年1月13日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于2015年1月22日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司副总经理。

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 5 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
国盛证券	1	344,230,503.18	11.37%	308,690.84	11.32%	-
银河证券	4	282,919,555.34	9.34%	252,123.90	9.24%	-
光大证券	2	259,697,308.43	8.58%	237,535.58	8.71%	-
东北证券	2	212,285,969.31	7.01%	192,014.34	7.04%	-
天风证券	1	211,973,092.53	7.00%	187,577.67	6.88%	-
瑞银证券	1	190,656,119.96	6.30%	174,543.31	6.40%	-
中金公司	2	189,617,508.53	6.26%	167,794.59	6.15%	-
兴业证券	2	150,913,841.81	4.98%	136,403.98	5.00%	-
英大证券	1	147,794,226.30	4.88%	134,551.88	4.93%	-
国金证券	2	145,790,214.28	4.81%	129,011.66	4.73%	-
国泰君安	2	142,756,350.19	4.71%	126,326.01	4.63%	-
北京高华	1	128,990,485.42	4.26%	119,239.32	4.37%	-
川财证券	1	110,990,683.76	3.67%	101,147.75	3.71%	-
华泰证券	1	81,513,477.44	2.69%	73,591.66	2.70%	-
民生证券	1	60,506,379.89	2.00%	55,084.68	2.02%	-
华西证券	1	52,445,030.16	1.73%	47,793.72	1.75%	-
红塔证券	1	51,546,038.55	1.70%	46,927.38	1.72%	-
方正证券	1	43,452,456.25	1.44%	40,132.26	1.47%	-
浙商证券	1	41,297,815.89	1.36%	36,545.07	1.34%	-
招商证券	2	40,544,589.15	1.34%	35,878.53	1.32%	-
中泰证券	1	38,569,799.82	1.27%	35,151.59	1.29%	-
海通证券	1	34,495,070.78	1.14%	30,525.07	1.12%	-
中信建投	2	33,664,146.65	1.11%	30,677.85	1.12%	-
南京证券	1	31,368,255.51	1.04%	28,606.77	1.05%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 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专用席位。

2、报告期内本基金交易单元变更情况，新增交易单元：第一创业、山西证券、联讯证券、华西证券、川财证券；退租交易单元：中信建投。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
瑞银证券	75,416,245.20	73.52%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	27,159,745.40	26.48%	-	0.00%	-	0.00%

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2015 年 7 月 3 日，基金管理人公告了《大成行业轮动股票型证券投资基金变更基金名称、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农业银行股份有限公司协商一致，自 2015 年 7 月 3 日起本基金名称变更为“大成行业轮动混合型证券投资基金”，基金简称变更为“大成行业轮动混合”；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