

大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金  
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。

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。

本报告中财务资料已经审计。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 7 月 8 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
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.....	10
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.....	11
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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的真实、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>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	46
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
13.1 备查文件目录 .....	56
13.2 存放地点 .....	57
13.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	大成正向回报灵活配置混合
基金主代码	001365
交易代码	001365
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 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	320,546,406.79 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上，通过严格控制组合下行风险，力争实现基金资产稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置目标是严格控制组合的下行风险，主要控制方式一是分析宏观经济形势和各类型资产价格变化趋势，灵活调整债券、股票等资产的投资比例，规避或减小某一类资产的趋势下行对组合的影响；二是对股票类风险资产坚持绝对收益投资理念，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，结合定性与定量分析，选择具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率+2%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。

### 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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道	北京复兴门内大街 28 号凯晨世

	7088 号招商银行大厦 32 层	贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	刘卓	刘士余

## 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》
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 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

## 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	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

## §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 7 月 8 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-69,521,405.06
本期利润	-43,339,904.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1262
本期加权平均净值利润率	-15.14%
本期基金份额净值增长率	-10.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-60,853,891.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1898
期末基金资产净值	285,689,763.75
期末基金份额净值	0.891
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-10.90%

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。

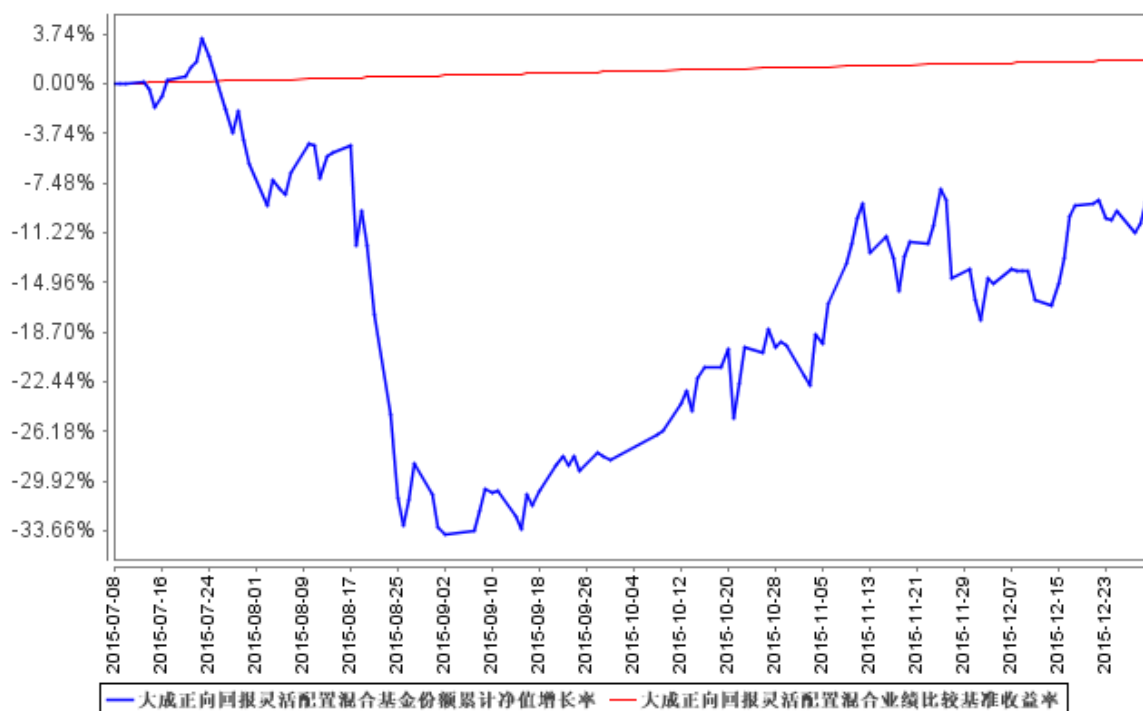
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	24.27%	2.38%	0.89%	0.01%	23.38%	2.37%
自基金合同生效起至今	-10.90%	2.61%	1.80%	0.01%	-12.70%	2.60%

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

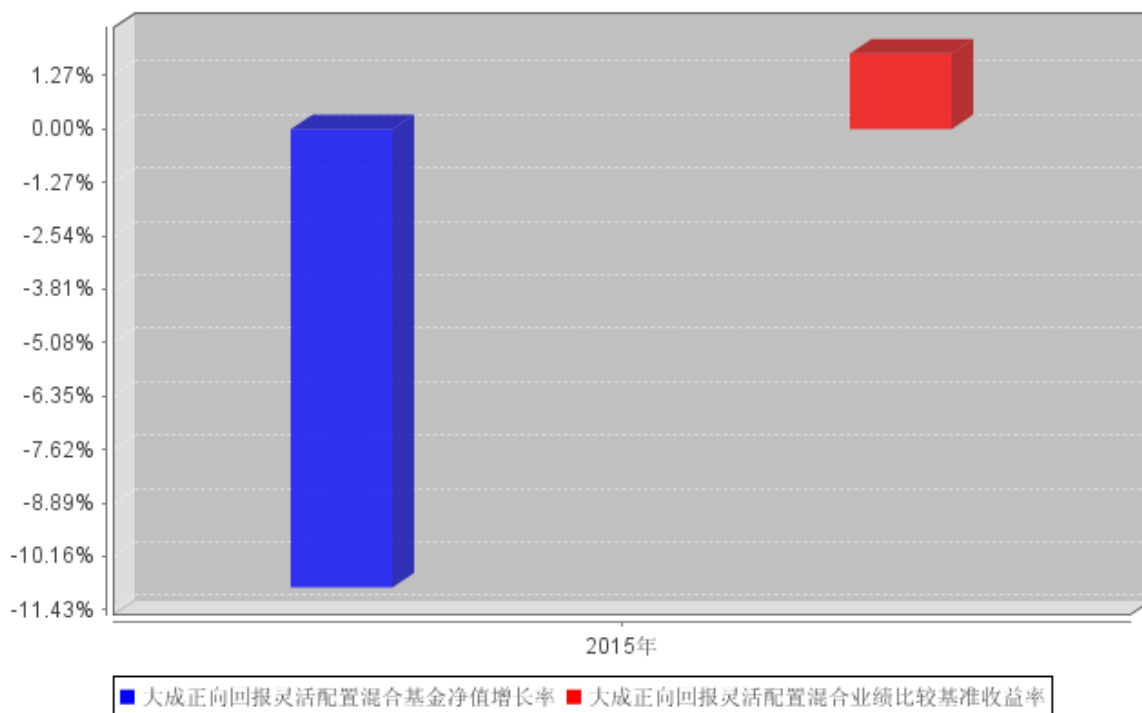


注：1、本基金合同于 2015 年 7 月 8 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基

金处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015 年净值增长率表现期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式



指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金, 2 只 QDII 基金: 大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 55 只开放式证券投资基金: 大成景丰债券型证券投资基金 (LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨挺先生	本基金基金经理	2015 年 7 月 8 日	-	8 年	工学硕士。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员; 2012 年 8 月起任职于大成基金

					管理有限公司研究部，历任研究部研究员。2014年3月18日起任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理助理。2014年6月26日至2015年7月21日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理，2015年7月22日起任大成健康产业混合型证券投资基金基金经理。2015年7月8日任大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《大成正向回报灵活配置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，大成正向回报灵活配置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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年的 A 股市场波动可谓惊心动魄，上证综指上下波动区间高达 2300 点（最低 2850，最高 5178），创业板指数上下波动区间高达 2600 点（最低 1429，最高 4037）。其中 6 月至 8 月，A 股投资者经历了中国股市目前罕见的深幅调整。不过总体来看，截止 12 月 18 日，各大类板块均在 2015 年录得向上的涨幅。从行业表现来看，2015 年表现最好的是新兴行业（如计算机、传媒等）和一些转型重组较多的传统行业（如轻工制造、纺织服装等）。

本基金进入三季度后开始建仓。进入三季度后，市场波动幅度明显加剧，7 月中旬国家开始救市措施以后，市场初步企稳，当时我们低估了杠杆资金出清的力量，也低估了市场的恐慌情绪，依然保持了较高仓位，因此在 8 月中旬指数从 4000 点快速跌落到 3000 点的过程中损失较重。之后我们判断市场杠杆资金已经出清，市场的悲观情绪已经过度释放，加上货币政策继续保持宽松，因此我们大胆参与了 9 月的反弹行情，挽回了部分损失。

四季度我们基本延续 9 月以来的操作思路，比较充分的享受了 10 月行情带来的回报，10 月

以后，市场进入震荡期，指数表现上停滞不前，不过主题和个股依然保持了较为活跃的状态，因此我们在 11、12 月依然保持了较高仓位，主要配置长期看好的一些标的，兼顾参与了部分主题，也获得了不错的效果。

总体来说，今年我们对市场风格和主题的把握是比较成功的，所挑选的标的也得到了市场的印证，但是，在下半年市场波动最大的几个月中，我们低估了杠杆出清带来的连锁反应，其中对于仓位和风控的探讨，值得我们长期思考和学习。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.891 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.90%，同期业绩比较基准收益率为 1.80%，低于业绩比较基准的表现。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年投资者最关注利率水平的变动，并且普遍认为只要中国的利率水平能够继续维持低位，则会带来“资产配置荒”，充裕的资金会增加股票配置，从而提升 A 股估值。

首先，针对“利率能否下台阶”这个问题，答案是肯定的。明年随着财政支出动力的减弱和地产小周期的结束，宏观经济可能再下台阶。具体来看，2016 年上半年，在“保增长”政策和地产投资恢复的带动下，经济有望维持弱稳定；2016 年下半年，随着财政支出后继乏力、地产周期结束、传统行业供给收缩，经济再次“下台阶”。而随着经济下台阶，利率水平也将进一步下台阶。

但是，利率下台阶并不意味着估值水平一定会提升。从海外经验来看，利率下行并不是股市上涨的充分条件。以美国和日本为例，90 年代同样是利率下台阶，从盈利来看美日企业差异巨大，美国的非金融上市公司 ROE（净资产收益率）明显高于贷款利率，企业供给扩张动力强，而日本虽然贷款利率持续下降，但 ROE（净资产收益率）也持续走低，企业供给扩张动力弱。从风险偏好来看，美日两国投资者对本国中长期产业前景的信心同样有很大差异。具体来说，美国国民对信息产业和金融的产业转型方向充满乐观，而日本在“地产泡沫”破裂后，虽然地价大幅下跌，但地产占 GDP 的比重仍在上升，这显示出日本国民经济缺少新的增长动力，国民看不到日本产业转型的希望。在这样的背景下，90 年代，美国居民储蓄意愿较弱，更倾向于配置风险资产，日本居民储蓄意愿较强，更倾向于配置避险资产。因此，即使“钱多”，也不会有“资产配置荒”，关键取决于居民是配置风险资产还是避险资产。

未来中国经济与 A 股市场面临的一个问题是，当前市场热议的“供给侧改革”已经进入了“深水區”，需要处理一些尖锐矛盾之间的冲突与平衡——长期供给改革和短期保增长的矛盾、大规模减税和化解政府债务的矛盾。当前传统重工业对中国国民经济依然有较强支撑作用，产能加速出

清容易导致经济增长显著下滑，这和短期的“保增长”政策可能形成潜在冲突。“供给侧改革”的另一重要精髓是减税，减税的背后是财政赤字的大幅增加，解决办法是大规模发行国债。而这就需要面临处理政府债务积累与全球对中国经济增长预期之间平衡的问题。期待政策能够化解这些问题，这将提振资本市场投资者对中长期转型和改革深化的预期。

针对市场走势，如果假设 2016 年利率水平还是向下，接下来关键取决于盈利趋势和风险偏好。就盈利趋势来看，新兴行业的外延收购能够保证正增长但增速可能放缓，传统行业的盈利趋势则取决于供给端变化，目前传统行业由于资产周转率的下滑 ROE（净资产收益率）已降至历史最低水平，接下来如果提升资产周转率需要将资产增速降为负，但资产负增长会对宏观经济造成严重冲击，这可能需要与“保增长”目标之间做一些平衡。就风险偏好来看，A 股投资者的风险偏好取决于转型和改革的推进力度。从产业转型来看，传统产业需求饱和、产能过剩，需要向新兴行业转型；从体制改革来看，行政管制束缚了经济发展的活力，需要放松管制、提升效率。

当前新兴行业盈利趋势尚可，但短期估值中枢需要有一个向下修复的过程；传统行业估值相对合理，但短期盈利趋势尚难改善。因此，中期慢牛之前，A 股短期可能会先经历一个估值和盈利的修复过程。

在行业配置方面，新兴行业中关注内生增长动力最强的消费服务业，在人均 GDP 提升和人口结构变迁的背景下，这是中国未来最为确定的产业发展方向，在消费服务业中应着重关注医疗服务、教育、传媒、信息服务等。针对传统行业，如果没有供给端的明显收缩，那么传统行业的 ROE（净资产收益率）将很难升，在这些领域里边作为次选标的可以关注制造业投资显著下降的传统行业，如煤炭、有色、钢铁、化纤等。

#### 4.6 管理人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数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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 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

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本基金的投资运作、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本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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“大成正向回报混合基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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正向回报灵活配置混合型证券投资基金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”)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。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	我们认为,上述大成正向回报混合基金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,公允反映了大成正向回报混合基金2015年12月31日的财务状况以及2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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：大成正向回报灵活配置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	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	40,253,730.62
结算备付金		2,830,502.93
存出保证金		729,333.35
交易性金融资产	7.4.7.2	252,431,748.96
其中：股票投资		252,431,748.96
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	6,238.57
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		296,251,554.43
<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>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		8,187,396.36
应付赎回款		434,208.58
应付管理人报酬		360,829.30
应付托管费		60,138.22
应付销售服务费		-

应付交易费用	7.4.7.7	1,418,140.14
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	101,078.08
负债合计		10,561,790.68
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	320,546,406.79
未分配利润	7.4.7.10	-34,856,643.04
所有者权益合计		285,689,763.75
负债和所有者权益总计		296,251,554.43

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.891 元，基金份额总额 320,546,406.79 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间，截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-36,895,294.37
1. 利息收入		392,876.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	392,876.80
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-63,607,089.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-63,646,352.80
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
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	39,263.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	26,181,500.36

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	137, 417. 58
<b>减：二、费用</b>		6, 444, 610. 33
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	2, 078, 840. 77
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	346, 473. 43
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 19	3, 862, 190. 02
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	157, 106. 11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-43, 339, 904. 70
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-43, 339, 904. 70

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 8 日（基金合同生效日）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）	368, 738, 178. 20	-	368, 738, 178. 20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-43, 339, 904. 70	-43, 339, 904. 70
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）	-48, 191, 771. 41	8, 483, 261. 66	-39, 708, 509. 75
其中：1. 基金申购款	6, 113, 790. 67	-990, 352. 45	5, 123, 438. 22
2. 基金赎回款	-54, 305, 562. 08	9, 473, 614. 11	-44, 831, 947. 97
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）	320, 546, 406. 79	-34, 856, 643. 04	285, 689, 763. 75

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

大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 868 号《关于准予大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 368,541,517.80 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 890 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 368,738,178.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 196,660.40 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票等权益类占基金资产的比例为 0%-95%;债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;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:一年期银行定期存款利率+2%。

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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 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 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

#### 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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。

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。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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 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
活期存款	40,253,730.62
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	40,253,730.62

### 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	226,250,248.60	252,431,748.96	26,181,500.36

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	226,250,248.60	252,431,748.96	26,181,500.36

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期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
应收活期存款利息	4,636.67
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	1,273.70
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	328.20
合计	6,238.57

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	1,418,140.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,418,140.14

## 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
预提审计费	50,000.00
预提信息披露费	50,000.00
应付赎回费	1,078.08
合计	101,078.08

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	368,738,178.20	368,738,178.20
本期申购	6,113,790.67	6,113,790.67
本期赎回(以“-”号填列)	-54,305,562.08	-54,305,562.08
本期末	320,546,406.79	320,546,406.79

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 6 月 15 日起至 2015 年 7 月 3 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 368,541,517.80 元。根据《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 196,660.40 元在本基金成立后，折算为 196,660.40 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 8 月 5 日止期间暂不向投资人开放基金交易。基金份额的申购、赎回、转换转入、转换转出以及定期定额投资业务自 2015 年 8 月 6 日起开始办理。

## 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-69,521,405.06	26,181,500.36	-43,339,904.70
本期基金份额交易产生的变动数	8,667,513.24	-184,251.58	8,483,261.66
其中：基金申购款	-1,313,150.94	322,798.49	-990,352.45
基金赎回款	9,980,664.18	-507,050.07	9,473,614.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,853,891.82	25,997,248.78	-34,856,643.04

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	373,815.17
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	16,647.89
其他	2,413.74
合计	392,876.80

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,186,454,671.07
减：卖出股票成本总额	1,250,101,023.87
买卖股票差价收入	-63,646,352.80

**7.4.7.13 债券投资收益**

本报告期内本基金无债券投资收益。

**7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本报告期本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	39,263.69

基金投资产生的股利收益	-
合计	39,263.69

## 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7月8日(基金合同生效日)至2015 年12月31日
1. 交易性金融资产	26,181,500.36
——股票投资	26,181,500.36
——债券投资	-
——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	26,181,500.36

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31 日
基金赎回费收入	137,417.58
合计	137,417.58

注：本基金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7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31 日
交易所市场交易费用	3,862,190.02
银行间市场交易费用	-
合计	3,862,190.02

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月
----	-----------------------------------

	31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	100,000.00
其他	500.00
银行划款手续费	6,606.11
合计	157,106.11

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需披露的重大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、基金注册登记机构
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。

#### 7.4.10 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 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	18,275,868.95	0.69%

**7.4.10.1.2 债券交易**

无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.4 权证交易**

无。

**7.4.10.1.5 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7月8日(基金合同生效日)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	16,654.76	0.69%	16,654.76	1.17%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

**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7月8日(基金合同生效日)至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,078,840.77
其中：支付销售机构的客户维护费	986,835.04

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 1.50%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 × 1.50% ÷ 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7月8日(基金合同生效日)至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	346,473.43

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×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

本基金本报告期内未与关联方进行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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资。

##### 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	40,253,730.62	373,815.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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	19.42	-	-	601,700	11,124,085.14	11,685,014.00	-
600584	长电科技	2015年11月30日	重大资产重组	22.02	-	-	254,300	5,680,171.00	5,599,686.00	-

#### 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

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。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通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。

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，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，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农业银行，因而与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，本基金未持有债券投资。

#### 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，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，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约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
<b>资产</b>					
银行存款	40,253,730.62	-	-	-	40,253,730.62
结算备付金	2,830,502.93	-	-	-	2,830,502.93
存出保证金	729,333.35	-	-	-	729,333.35
交易性金融资产	-	-	-	252,431,748.96	252,431,748.96
应收利息	-	-	-	6,238.57	6,238.57
资产总计	43,813,566.90	-	-	252,437,987.53	296,251,554.43
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	8,187,396.36	8,187,396.36
应付赎回款	-	-	-	434,208.58	434,208.58
应付管理人报酬	-	-	-	360,829.30	360,829.30
应付托管费	-	-	-	60,138.22	60,138.22
应付交易费用	-	-	-	1,418,140.14	1,418,140.14
其他负债	-	-	-	101,078.08	101,078.08
负债总计	-	-	-	10,561,790.68	10,561,790.68
利率敏感度缺口	43,813,566.90	-	-	241,876,196.85	285,689,763.75

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

#### 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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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，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其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%；债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于 5%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	252,431,748.96	88.36
交易性金融资产-基金投资	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00

其他	-	0.00
合计	252,431,748.96	88.36

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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:人民币万元)
		2015 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 885
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 885

#### 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为 235,147,048.96 元，属于第二层次的余额为 17,284,700.00 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) 第三层次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。

##### (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	252,431,748.96	85.21
	其中：股票	252,431,748.96	85.21
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	43,084,233.55	14.54
7	其他各项资产	735,571.92	0.25
8	合计	296,251,554.43	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	181,645,828.52	63.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	38,435,966.84	13.45
G	交通运输、仓储和邮政业	8,195,928.00	2.87
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,154,025.60	8.45

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	252,431,748.96	88.36

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	002355	兴民钢圈	1,361,100	27,303,666.00	9.56
2	300078	思创医惠	530,384	25,882,739.20	9.06
3	000078	海王生物	768,579	18,415,152.84	6.45
4	300109	新开源	166,500	17,324,325.00	6.06
5	002019	亿帆鑫富	404,900	16,196,000.00	5.67
6	000952	广济药业	647,800	14,899,400.00	5.22
7	002730	电光科技	243,810	11,980,823.40	4.19
8	002517	泰亚股份	194,964	11,803,120.56	4.13
9	600122	宏图高科	601,700	11,685,014.00	4.09
10	600520	中发科技	369,600	10,304,448.00	3.61
11	600079	人福医药	440,000	9,794,400.00	3.43
12	002421	达实智能	436,600	9,561,540.00	3.35
13	002599	盛通股份	213,051	8,679,697.74	3.04
14	000516	国际医学	378,900	8,335,800.00	2.92
15	600017	日照港	1,253,200	8,195,928.00	2.87
16	002467	二六三	386,500	8,112,635.00	2.84
17	600217	*ST 秦岭	749,660	7,811,457.20	2.73

18	300209	天泽信息	251,157	6,479,850.60	2.27
19	000566	海南海药	151,500	5,887,290.00	2.06
20	600584	长电科技	254,300	5,599,686.00	1.96
21	603318	派思股份	100,262	5,505,386.42	1.93
22	002662	京威股份	109,800	2,415,600.00	0.85
23	002433	太安堂	15,900	236,274.00	0.08
24	300497	富祥股份	500	21,515.00	0.01

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000722	湖南发展	44,059,688.09	15.42
2	002019	亿帆鑫富	35,664,333.69	12.48
3	300109	新开源	29,276,769.00	10.25
4	000938	紫光股份	27,838,115.00	9.74
5	000078	海王生物	26,232,322.81	9.18
6	300078	思创医惠	20,644,088.00	7.23
7	002572	索菲亚	20,575,427.98	7.20
8	002355	兴民钢圈	20,028,446.75	7.01
9	002517	泰亚股份	19,609,274.71	6.86
10	000910	大亚科技	17,613,991.84	6.17
11	300147	香雪制药	17,495,245.41	6.12
12	300464	星徽精密	17,494,794.80	6.12
13	002422	科伦药业	16,788,749.00	5.88
14	600520	中发科技	16,663,554.70	5.83
15	000926	福星股份	16,586,427.78	5.81
16	600303	曙光股份	15,709,745.41	5.50
17	300017	网宿科技	15,609,531.47	5.46
18	000952	广济药业	15,365,944.02	5.38
19	000796	凯撒旅游	14,945,145.69	5.23
20	601009	南京银行	14,328,233.20	5.02
21	002085	万丰奥威	14,289,562.97	5.00
22	600518	康美药业	14,103,758.00	4.94
23	002175	东方网络	14,084,590.92	4.93



24	002366	台海核电	14,027,648.07	4.91
25	600804	鹏博士	13,878,427.20	4.86
26	600998	九州通	13,485,859.00	4.72
27	000776	广发证券	13,372,737.08	4.68
28	300244	迪安诊断	13,324,699.00	4.66
29	300432	富临精工	13,075,686.45	4.58
30	300255	常山药业	12,972,580.42	4.54
31	000100	TCL 集团	12,385,051.00	4.34
32	600521	华海药业	12,248,380.40	4.29
33	300250	初灵信息	12,103,858.14	4.24
34	600418	江淮汽车	11,600,130.18	4.06
35	300064	豫金刚石	11,593,350.31	4.06
36	002730	电光科技	11,520,294.00	4.03
37	600343	航天动力	11,326,347.00	3.96
38	000028	国药一致	11,267,016.16	3.94
39	600172	黄河旋风	11,134,824.00	3.90
40	600122	宏图高科	11,124,085.14	3.89
41	600276	恒瑞医药	11,054,782.22	3.87
42	300178	腾邦国际	11,005,636.94	3.85
43	300284	苏交科	10,848,969.82	3.80
44	002584	西陇科学	10,791,255.35	3.78
45	300395	菲利华	10,773,340.81	3.77
46	600572	康恩贝	10,542,170.89	3.69
47	300136	信维通信	10,513,441.00	3.68
48	600017	日照港	10,512,858.00	3.68
49	600055	华润万东	10,510,029.00	3.68
50	300098	高新兴	10,455,958.20	3.66
51	002113	天润控股	10,430,428.61	3.65
52	002421	达实智能	10,416,888.02	3.65
53	600750	江中药业	10,293,122.00	3.60
54	300427	红相电力	10,189,638.00	3.57
55	600108	亚盛集团	10,094,105.00	3.53
56	300161	华中数控	10,078,401.74	3.53
57	002299	圣农发展	10,073,688.12	3.53
58	300166	东方国信	10,049,473.67	3.52
59	002071	长城影视	9,999,730.00	3.50

60	002547	春兴精工	9,888,953.00	3.46
61	603885	吉祥航空	9,560,306.65	3.35
62	002354	天神娱乐	9,456,507.00	3.31
63	002429	兆驰股份	9,103,691.60	3.19
64	300331	苏大维格	9,002,109.07	3.15
65	600826	兰生股份	8,779,836.00	3.07
66	002599	盛通股份	8,756,772.66	3.07
67	000516	国际医学	8,705,784.00	3.05
68	600478	科力远	8,701,336.83	3.05
69	300390	天华超净	8,653,794.64	3.03
70	000802	北京文化	8,605,268.00	3.01
71	002117	东港股份	8,559,516.68	3.00
72	002467	二六三	8,552,106.00	2.99
73	002364	中恒电气	8,543,153.56	2.99
74	002583	海能达	8,468,709.04	2.96
75	002279	久其软件	8,457,621.22	2.96
76	600079	人福医药	8,358,954.00	2.93
77	600461	洪城水业	8,206,467.52	2.87
78	002667	鞍重股份	8,185,786.00	2.87
79	002381	双箭股份	7,977,752.99	2.79
80	002701	奥瑞金	7,974,930.39	2.79
81	600837	海通证券	7,950,514.00	2.78
82	601688	华泰证券	7,932,797.97	2.78
83	300203	聚光科技	7,870,003.27	2.75
84	002044	江苏三友	7,545,382.08	2.64
85	300329	海伦钢琴	7,448,626.36	2.61
86	002089	新海宜	7,384,069.23	2.58
87	000030	富奥股份	7,326,752.20	2.56
88	600420	现代制药	7,286,760.48	2.55
89	600038	中直股份	7,273,930.92	2.55
90	600990	四创电子	7,219,495.50	2.53
91	300364	中文在线	7,199,805.00	2.52
92	002450	康得新	7,020,066.82	2.46
93	300450	先导智能	7,007,473.00	2.45
94	600217	*ST 秦岭	6,858,986.98	2.40
95	000797	中国武夷	6,853,881.99	2.40

96	600963	岳阳林纸	6,803,420.00	2.38
97	002674	兴业科技	6,776,056.74	2.37
98	002234	民和股份	6,765,576.87	2.37
99	300209	天泽信息	6,734,236.90	2.36
100	601012	隆基股份	6,733,443.00	2.36
101	002363	隆基机械	6,723,754.00	2.35
102	002157	正邦科技	6,711,026.01	2.35
103	002022	科华生物	6,704,735.00	2.35
104	000411	英特集团	6,697,092.72	2.34
105	002714	牧原股份	6,677,828.00	2.34
106	002226	江南化工	6,035,101.58	2.11
107	300299	富春通信	5,870,450.25	2.05
108	002458	益生股份	5,861,388.00	2.05
109	600815	厦工股份	5,800,352.00	2.03
110	000687	华讯方舟	5,775,064.00	2.02
111	002548	金新农	5,749,118.22	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000722	湖南发展	37,128,188.06	13.00
2	000938	紫光股份	28,319,564.95	9.91
3	002085	万丰奥威	22,939,637.39	8.03
4	002572	索菲亚	21,598,973.28	7.56
5	300464	星徽精密	19,297,093.01	6.75
6	000910	大亚科技	18,076,077.47	6.33
7	002019	亿帆鑫富	17,756,307.86	6.22
8	300432	富临精工	17,184,035.65	6.01
9	002517	泰亚股份	16,614,188.38	5.82
10	300147	香雪制药	15,981,538.77	5.59
11	002422	科伦药业	15,396,431.18	5.39
12	600303	曙光股份	15,226,839.56	5.33
13	002175	东方网络	14,902,168.25	5.22
14	300017	网宿科技	14,358,003.78	5.03
15	000776	广发证券	14,001,753.29	4.90

16	300255	常山药业	13,813,586.88	4.84
17	000926	福星股份	13,660,302.81	4.78
18	601009	南京银行	13,435,359.84	4.70
19	300250	初灵信息	13,396,961.80	4.69
20	300109	新开源	13,298,313.27	4.65
21	000100	TCL 集团	12,405,030.00	4.34
22	000796	凯撒旅游	12,065,574.11	4.22
23	600343	航天动力	12,052,348.23	4.22
24	300244	迪安诊断	11,989,033.45	4.20
25	000028	国药一致	11,748,469.28	4.11
26	002113	天润控股	11,688,149.50	4.09
27	300064	豫金刚石	11,602,332.38	4.06
28	600521	华海药业	11,404,461.86	3.99
29	600518	康美药业	10,793,677.70	3.78
30	600572	康恩贝	10,708,686.75	3.75
31	600461	洪城水业	10,659,989.60	3.73
32	600750	江中药业	10,644,175.91	3.73
33	300284	苏交科	10,620,593.34	3.72
34	300395	菲利华	10,608,176.24	3.71
35	300178	腾邦国际	10,515,783.56	3.68
36	600998	九州通	10,242,812.74	3.59
37	600418	江淮汽车	10,164,810.11	3.56
38	600276	恒瑞医药	10,085,792.52	3.53
39	300331	苏大维格	10,045,469.61	3.52
40	600804	鹏博士	9,999,792.00	3.50
41	603885	吉祥航空	9,981,486.87	3.49
42	002366	台海核电	9,978,444.72	3.49
43	002429	兆驰股份	9,874,738.96	3.46
44	300078	思创医惠	9,749,680.84	3.41
45	300390	天华超净	9,699,991.13	3.40
46	002354	天神娱乐	9,591,665.40	3.36
47	600826	兰生股份	9,545,359.00	3.34
48	600172	黄河旋风	9,494,480.05	3.32
49	300329	海伦钢琴	9,304,553.58	3.26
50	002071	长城影视	9,222,410.05	3.23
51	300161	华中数控	9,033,917.86	3.16
52	002299	圣农发展	8,917,348.62	3.12
53	600108	亚盛集团	8,530,216.25	2.99

54	000078	海王生物	8,523,280.00	2.98
55	600055	华润万东	8,437,060.24	2.95
56	002667	鞍重股份	8,373,894.00	2.93
57	002089	新海宜	8,303,680.02	2.91
58	000802	北京文化	8,239,171.27	2.88
59	002701	奥瑞金	8,176,623.30	2.86
60	300203	聚光科技	8,147,225.48	2.85
61	600420	现代制药	8,111,165.00	2.84
62	300427	红相电力	8,045,192.00	2.82
63	601688	华泰证券	7,784,561.00	2.72
64	300232	洲明科技	7,751,495.00	2.71
65	600837	海通证券	7,729,888.60	2.71
66	300136	信维通信	7,640,328.00	2.67
67	002279	久其软件	7,598,371.37	2.66
68	002584	西陇科学	7,398,565.74	2.59
69	002450	康得新	7,247,096.82	2.54
70	002381	双箭股份	7,132,781.55	2.50
71	600478	科力远	6,971,429.97	2.44
72	600520	中发科技	6,834,891.93	2.39
73	002776	柏堡龙	6,812,555.05	2.38
74	002458	益生股份	6,790,471.00	2.38
75	002022	科华生物	6,761,542.44	2.37
76	000892	*ST 星美	6,564,829.30	2.30
77	601012	隆基股份	6,509,342.62	2.28
78	000030	富奥股份	6,475,777.78	2.27
79	000700	模塑科技	6,473,185.50	2.27
80	300450	先导智能	6,468,516.50	2.26
81	300166	东方国信	6,455,143.72	2.26
82	603555	贵人鸟	6,427,209.71	2.25
83	000797	中国武夷	6,399,092.35	2.24
84	300098	高新兴	6,374,500.00	2.23
85	002117	东港股份	6,178,486.74	2.16
86	600815	厦工股份	6,125,113.28	2.14
87	600990	四创电子	6,087,980.00	2.13
88	600963	岳阳林纸	6,084,751.34	2.13
89	000411	英特集团	6,058,393.40	2.12
90	300282	汇冠股份	5,915,630.20	2.07
91	002547	春兴精工	5,871,558.00	2.06

92	600038	中直股份	5,866,366.20	2.05
93	002548	金新农	5,806,052.80	2.03

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	1,476,351,272.47
卖出股票收入（成交）总额	1,186,454,671.07

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	729,333.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,238.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	735,571.92

### 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	11,685,014.00	4.09	重大事项

### 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
5,641	56,824.39	1,230,065.62	0.38%	319,316,341.17	99.62%

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	0.00	0.0000%

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月8日）基金份额总额	368,738,178.20
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,113,790.67
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	54,305,562.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	320,546,406.79

## § 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

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)，本年度支付的审计费用为 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

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	136,797,496.31	5.14%	127,398.43	5.24%	-
川财证券	1	124,511,802.76	4.68%	113,469.51	4.67%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	165,825,897.95	6.23%	151,120.52	6.22%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	18,275,868.95	0.69%	16,654.76	0.69%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	485,457,409.57	18.23%	442,541.57	18.21%	-
国盛证券	1	44,478,265.15	1.67%	40,533.51	1.67%	-
国泰君安	2	112,391,344.95	4.22%	102,037.51	4.20%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	139,830,667.79	5.25%	127,429.02	5.24%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	152,858,493.79	5.74%	139,301.30	5.73%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
联讯证券	1	62,269,970.58	2.34%	56,747.74	2.33%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	23,686,948.03	0.89%	22,059.76	0.91%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	18,797,602.90	0.71%	17,506.15	0.72%	-
山西证券	1	107,594,339.83	4.04%	98,050.68	4.03%	-
上海证券	1	176,335,172.21	6.62%	164,219.72	6.76%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-

世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	100,008,779.48	3.76%	88,498.39	3.64%	-
银河证券	4	241,165,821.76	9.06%	218,213.49	8.98%	-
英大证券	1	53,857,411.45	2.02%	50,157.94	2.06%	-
招商证券	2	228,515,858.83	8.58%	208,939.52	8.60%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	270,139,126.25	10.14%	245,658.77	10.11%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	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。

本基金本报告期末所有席位均为本报告期内新增。本报告期内本基金退租席位：无。

**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**

无。

**11.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 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
2	大成正向回报灵活配置混合型基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/4
3	关于大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
4	大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/12
5	大成正向回报灵活配置混合型基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/12
6	大成正向回报灵活配置混合型基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/12
7	大成正向回报灵活配置混合型基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/12
8	大成正向回报灵活配置混合型基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/12
9	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	2015/8/4
10	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	2015/8/25
11	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
12	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	2015/10/21
13	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	2015/10/31
14	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
15	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
16	大成基金管理有限公司关于网上交易银联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
17	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
18	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

19	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
20	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
21	大成基金管理有限公司关于网上交易银联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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	“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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	大成基金管理有限公司关于高级管理人员	中国证监会指定报	2015/5/5

	变更的公告	刊及本公司网站	
38	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
39	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
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	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
55	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

56	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
57	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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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
64	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
65	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
66	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
67	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
68	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
69	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
70	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
71	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
72	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
73	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
74	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

75	关于增加深圳市新兰德证券投资咨询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	2015/11/16
76	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
77	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
78	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
79	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
80	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
81	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
82	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

无。

## § 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正向回报灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 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

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 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。

大成基金管理有限公司  
2016年3月26日