

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 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.....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	大成中小盘混合(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	323,017,730.39份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-04-30

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	广东省深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-112,638,359.75
本期利润	-128,763,719.97
加权平均基金份额本期利润	-0.3324
本期加权平均净值利润率	-18.74%
本期基金份额净值增长率	-18.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	262,009,320.80
期末可供分配基金份额利润	0.8111
期末基金资产净值	593,817,403.41
期末基金份额净值	1.838
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	104.04%

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

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为

期末余额，不是当期发生数)。

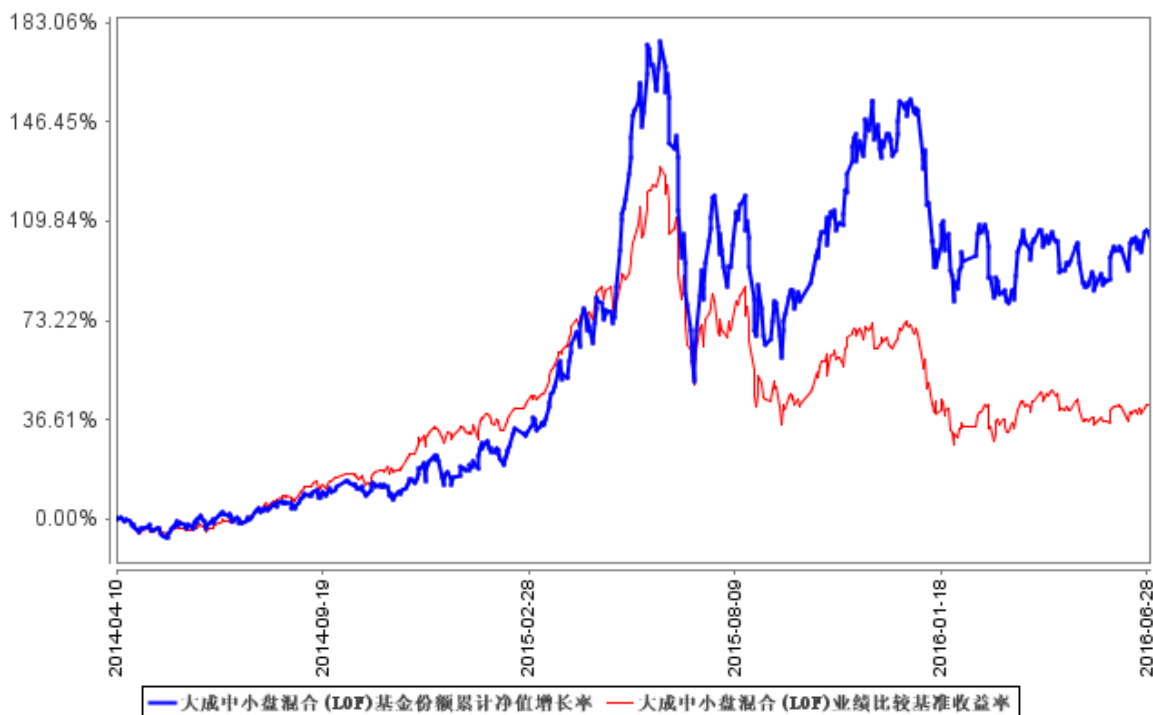
3、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.96%	1.84%	1.49%	1.14%	2.47%	0.70%
过去三个月	0.55%	1.75%	-1.04%	1.21%	1.59%	0.54%
过去六个月	-18.64%	2.50%	-15.42%	1.95%	-3.22%	0.55%
过去一年	-0.43%	2.95%	-24.90%	2.27%	24.47%	0.68%
自基金合同生效起至今	104.04%	2.45%	42.20%	1.83%	61.84%	0.62%

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，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准,于 1999 年 4 月 12 日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为 2 亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由三家股东组成,分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金:大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金, 2 只 QDII 基金:大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 61 只开放式证券投资基金:大成景丰债券型证券投资基金(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大

成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、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、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金、大成慧成货币市场基金、大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金和大成景华一年定期开放债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏庆国先生	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。2016年3月22日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 9 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在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% 的情形；投资组合间存在 2 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金上半年表现较差，没有重仓参与新能源汽车产业链和半导体产业链这两个主线的行情，

对于长期关注的次新股由于大部分质地很差或者是估值太高也没有重仓参与，错过了上半年这些最为火爆的行情。此外，对于基本面变化不是太大，主要是比价关系占优的家电、食品饮料等消费品也配置较低。反思过去 1 年半的所有操作，在投资上有两个方面需要进一步改进的地方。第一个是就一定要找到当下市场的主线，过去 1 年半的投资过程中，由于个股思维偏重，更多从个股本身的变化来思考，容易偏离市场的主线和主逻辑。未来将通过每天去反复比较不同行业的边际变化和新增品种，通过选美来选出来当下市场最热的主线，并且在主逻辑被证伪之前或者说边际恶化之前始终围绕这个主线去选股。第二个方面就是对于基本面的研究深度不够，上半年几乎最早参与了电池、OLED、半导体材料及设备、智能驾驶等诸多市场主线的龙头股，但是由于基本面研究不够深入，跟踪不到位不及时，没有持有至到期。未来将更专注于主线里龙头股基本面的研究，努力通过深入学习，解决基本面方面的问题。未来本基金将更严格的执行自己的选股思路、主线思路，深入研究个股的基本面和走势，希望在下半年为投资者带来更好的回报。

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 1.838 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.64%，同期业绩比较基准收益率为-15.42%，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

展望后半场，对于指数的看法我们认为仍然会处于一个中枢震荡之中，向下突破对应的崩溃情景和向上突破对应的全面好转的情景都是小概率事件，这个走势判断和基本面 L 型的分析是能够对应的。指数之外，对于板块主线，我们认为国企改革尤其是有推动混改、员工持股等市场化改革的公司值得关注。个股选择上，依然是选择有野心的企业家，有远大前景的行业，有壁垒的商业模式和有弹性的价格。区别于去年，今年可能对于确定性的要求会更高。

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	115,552,311.41	155,748,366.68
结算备付金		6,657,937.36	9,560,660.51
存出保证金		1,215,006.81	942,126.32
交易性金融资产	6.4.3.2	500,140,353.12	498,071,117.30
其中：股票投资		500,140,353.12	498,071,117.30
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	23,576.86	35,109.94
应收股利		-	-
应收申购款		107,505.01	3,490,908.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		623,696,690.57	667,848,289.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20,237,719.65	42,642,705.92
应付赎回款		2,472,274.22	1,192,268.57

应付管理人报酬		730,735.41	727,081.64
应付托管费		121,789.24	121,180.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	5,703,475.47	5,270,428.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	613,293.17	561,795.41
负债合计		29,879,287.16	50,515,460.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	323,017,730.39	273,326,407.00
未分配利润	6.4.3.10	270,799,673.02	344,006,421.67
所有者权益合计		593,817,403.41	617,332,828.67
负债和所有者权益总计		623,696,690.57	667,848,289.24

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.838 元，基金份额总额 323,017,730.39 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-106,355,026.31	202,706,166.45
1.利息收入		654,977.00	216,231.91
其中：存款利息收入	6.4.3.11	654,977.00	216,231.91
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）		-91,947,259.66	290,373,767.76
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-93,362,137.90	289,973,826.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,414,878.24	399,941.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-16,125,360.22	-90,391,927.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	1,062,616.57	2,508,094.40

减：二、费用		22,408,693.66	13,570,735.23
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	5,148,217.80	3,150,760.27
2. 托管费	6.4.6.2.2	858,036.34	525,126.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	16,177,365.49	9,619,073.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	225,074.03	275,774.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-128,763,719.97	189,135,431.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-128,763,719.97	189,135,431.22

6.3 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)

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	273,326,407.00	344,006,421.67	617,332,828.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-128,763,719.97	-128,763,719.97
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）	49,691,323.39	55,556,971.32	105,248,294.71
其中：1.基金申购款	220,297,503.91	184,418,227.27	404,715,731.18
2.基金赎回款	-170,606,180.52	-128,861,255.95	-299,467,436.47
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）	323,017,730.39	270,799,673.02	593,817,403.41
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		

如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	115,552,311.41
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	115,552,311.41

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	475,522,376.20	500,140,353.12	24,617,976.92
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	475,522,376.20	500,140,353.12	24,617,976.92

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	20,387.83
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	2,696.91
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	492.12
合计	23,576.86

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,703,475.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,703,475.47

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	4,444.53
预提费用	358,848.64
合计	613,293.17

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	273,326,407.00	273,326,407.00
本期申购	220,297,503.91	220,297,503.91
本期赎回(以“-”号填列)	-170,606,180.52	-170,606,180.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	323,017,730.39	323,017,730.39

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	305,355,939.24	38,650,482.43	344,006,421.67
本期利润	-112,638,359.75	-16,125,360.22	-128,763,719.97
本期基金份额交易产生的变动数	69,291,741.31	-13,734,769.99	55,556,971.32
其中：基金申购款	206,109,909.11	-21,691,681.84	184,418,227.27
基金赎回款	-136,818,167.80	7,956,911.85	-128,861,255.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	262,009,320.80	8,790,352.22	270,799,673.02

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	575,360.86
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	69,941.47
其他	9,674.67
合计	654,977.00

6.4.3.12 股票投资收益**6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	5,353,394,228.67
减：卖出股票成本总额	5,446,756,366.57
买卖股票差价收入	-93,362,137.90

6.4.3.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,414,878.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,414,878.24

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-16,125,360.22
——股票投资	-16,125,360.22
——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	-16,125,360.22

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,062,616.57
合计	1,062,616.57

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

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	16,177,365.49
银行间市场交易费用	-
合计	16,177,365.49

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
上市年费	29,835.26
银行划款手续费	10,225.39

中债登债券托管账户维护费	6,000.00
其他	-
合计	225,074.03

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“大成基金”)董事会及股东会的有关决议，大成基金原股东广东证券股份有限公司将所持大成基金2%股权以拍卖竞买的方式转让给大成基金股东中泰信托有限责任公司。上述股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于2016年4月25日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(2016年4月25日前)
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	2,160,736,935.64	19.97%	-	0.00%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	1,969,109.48	19.96%	1,132,667.56	19.86%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	-	0.00%	-	0.00%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	5,148,217.80
其中：支付销售机构的客户维护费	713,696.92	130,699.98

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	858,036.34	525,126.76

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日(2014年4月10日)持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期初持有的基金份额	-	12,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00	4.98%

注：1、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金，自基金合同生效日起所持有的份额由基金转型而来，并且基金管理人已在2015年度赎回该份额。

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

6.4.6.4.2 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	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日

称	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	-	0.0000%	6,000,000.00	2.2000%

注：本基金除管理人之外的其他关联方投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

6.4.6.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	115,552,311.41	575,360.86	72,045,004.29	183,374.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 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。

6.4.6.7 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。

6.4.7 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配事项。

6.4.8 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.8.2 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
600149	廊 坊	2016 年4	临 时	16.70	2016 年7	14.98	1,977,100	30,149,972.50	33,017,570.00	-

	发展	月 13	停牌		月 21					
	日期	日	日期		日					
300166	东方国信	2016年6月8日	临时停牌	28.23	-	-	672,096	17,146,762.98	18,973,270.08	-
300038	梅泰诺	2015年12月16日	临时停牌	50.62	-	-	195,900	10,927,062.00	9,916,458.00	-

6.4.8.3 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	115,552,311.41	-	-	-	115,552,311.41
结算备付金	6,657,937.36	-	-	-	6,657,937.36
存出保证金	1,215,006.81	-	-	-	1,215,006.81
交易性金融资产	-	-	-	500,140,353.12	500,140,353.12
应收利息	-	-	-	23,576.86	23,576.86
应收申购款	2,982.11	-	-	104,522.90	107,505.01
资产总计	123,428,237.69	-	-	500,268,452.88	623,696,690.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	20,237,719.65	20,237,719.65
应付赎回款	-	-	-	2,472,274.22	2,472,274.22
应付管理人报酬	-	-	-	730,735.41	730,735.41
应付托管费	-	-	-	121,789.24	121,789.24
应付交易费用	-	-	-	5,703,475.47	5,703,475.47

其他负债	-	-	-	613,293.17	613,293.17
负债总计	-	-	-	29,879,287.16	29,879,287.16
利率敏感度缺口	123,428,237.69	-	-	-470,389,165.72	593,817,403.41
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	155,748,366.68	-	-	-	155,748,366.68
结算备付金	9,560,660.51	-	-	-	9,560,660.51
存出保证金	942,126.32	-	-	-	942,126.32
交易性金融资产	-	-	-	-498,071,117.30	498,071,117.30
应收利息	-	-	-	35,109.94	35,109.94
应收申购款	249,103.00	-	-	3,241,805.49	3,490,908.49
资产总计	166,500,256.51	-	-	-501,348,032.73	667,848,289.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	42,642,705.92	42,642,705.92
应付赎回款	-	-	-	1,192,268.57	1,192,268.57
应付管理人报酬	-	-	-	727,081.64	727,081.64
应付托管费	-	-	-	121,180.28	121,180.28
应付交易费用	-	-	-	5,270,428.75	5,270,428.75
其他负债	-	-	-	561,795.41	561,795.41
负债总计	-	-	-	50,515,460.57	50,515,460.57
利率敏感度缺口	166,500,256.51	-	-	-450,832,572.16	617,332,828.67

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	500,140,353.12	84.22	498,071,117.30	80.68
交易性金融资产—基金投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—债券投资	—	0.00	—	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	0.00	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	0.00	—	0.00
其他	—	0.00	—	0.00
合计	500,140,353.12	84.22	498,071,117.30	80.68

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	35,690,000.00	37,470,000.00
	业绩比较基准下降5%	-35,690,000.00	-37,470,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	500,140,353.12	80.19
	其中：股票	500,140,353.12	80.19
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	122,210,248.77	19.59
7	其他各项资产	1,346,088.68	0.22
8	合计	623,696,690.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	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	367,479,125.57	61.88
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	44,020,372.47	7.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,623,285.08	9.37
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	33,017,570.00	5.56
	合计	500,140,353.12	84.22

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 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	002547	春兴精工	3,859,056	42,681,159.36	7.19
2	000581	威孚高科	1,753,378	35,348,100.48	5.95
3	600149	廊坊发展	1,977,100	33,017,570.00	5.56
4	000021	深科技	2,334,800	25,706,148.00	4.33
5	601689	拓普集团	771,159	25,409,689.05	4.28
6	300375	鹏翎股份	931,584	25,180,715.52	4.24
7	002609	捷顺科技	1,401,700	24,655,903.00	4.15
8	600110	诺德股份	2,491,100	24,512,424.00	4.13
9	002529	海源机械	1,193,100	24,446,619.00	4.12
10	300101	振芯科技	859,600	24,008,628.00	4.04
11	300156	神雾环保	1,146,639	23,597,830.62	3.97
12	002462	嘉事堂	617,175	22,989,768.75	3.87

13	002434	万里扬	2,014,700	21,919,936.00	3.69
14	603268	松发股份	542,700	21,670,011.00	3.65
15	600386	北巴传媒	1,127,042	21,030,603.72	3.54
16	300136	信维通信	948,324	19,876,871.04	3.35
17	300166	东方国信	672,096	18,973,270.08	3.20
18	300326	凯利泰	708,800	17,712,912.00	2.98
19	300322	硕贝德	646,991	13,910,306.50	2.34
20	600571	信雅达	217,600	11,994,112.00	2.02
21	002675	东诚药业	248,900	11,581,317.00	1.95
22	300038	梅泰诺	195,900	9,916,458.00	1.67

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300078	思创医惠	94,008,450.38	15.23
2	000581	威孚高科	81,372,064.67	13.18
3	601689	拓普集团	72,091,356.93	11.68
4	300178	腾邦国际	66,887,723.66	10.83
5	300009	安科生物	66,152,903.72	10.72
6	603398	邦宝益智	65,892,704.59	10.67
7	002730	电光科技	65,626,154.28	10.63
8	300467	迅游科技	65,008,618.02	10.53
9	601398	工商银行	63,552,166.20	10.29
10	300166	东方国信	63,443,575.66	10.28
11	002094	青岛金王	61,909,681.90	10.03
12	002655	共达电声	58,339,822.57	9.45
13	600386	北巴传媒	57,137,334.35	9.26
14	002050	三花股份	54,620,355.99	8.85
15	300098	高新兴	54,596,749.12	8.84
16	002537	海立美达	54,483,864.36	8.83
17	002235	安妮股份	54,272,188.00	8.79
18	000526	紫光学大	53,855,933.47	8.72
19	600826	兰生股份	51,583,838.61	8.36
20	300395	菲利华	50,621,383.48	8.20

21	002668	奥马电器	49,829,279.86	8.07
22	002624	完美环球	49,615,931.72	8.04
23	600198	大唐电信	48,279,948.39	7.82
24	300377	赢时胜	46,717,127.25	7.57
25	300018	中元股份	46,368,845.10	7.51
26	300101	振芯科技	46,047,998.54	7.46
27	603268	松发股份	44,918,745.64	7.28
28	300384	三联虹普	44,725,381.99	7.24
29	000779	三毛派神	43,019,910.43	6.97
30	300236	上海新阳	42,679,876.83	6.91
31	002547	春兴精工	42,317,070.67	6.85
32	002245	澳洋顺昌	41,469,779.30	6.72
33	002343	慈文传媒	41,328,611.61	6.69
34	600958	东方证券	40,872,275.56	6.62
35	002664	信质电机	39,894,460.65	6.46
36	002032	苏泊尔	38,206,457.54	6.19
37	603601	再升科技	37,793,766.80	6.12
38	300183	东软载波	37,381,899.02	6.06
39	000810	创维数字	37,219,610.81	6.03
40	300342	天银机电	37,004,480.28	5.99
41	600235	民丰特纸	36,714,892.30	5.95
42	300047	天源迪科	36,080,166.68	5.84
43	600306	*ST 商城	35,931,104.75	5.82
44	600547	山东黄金	34,323,892.29	5.56
45	000925	众合科技	34,308,172.21	5.56
46	300339	润和软件	34,044,190.54	5.51
47	300241	瑞丰光电	32,962,804.16	5.34
48	300304	云意电气	32,276,053.52	5.23
49	000892	星美联合	31,977,263.05	5.18
50	300224	正海磁材	31,957,436.65	5.18
51	300033	同花顺	31,702,113.66	5.14
52	002239	奥特佳	31,610,118.51	5.12
53	002662	京威股份	31,459,143.99	5.10
54	300396	迪瑞医疗	31,265,866.47	5.06
55	000657	中钨高新	31,149,396.57	5.05
56	002264	新华都	30,964,467.50	5.02

57	000070	特发信息	30,790,595.69	4.99
58	300011	鼎汉技术	30,536,411.73	4.95
59	002587	奥拓电子	30,396,649.90	4.92
60	300326	凯利泰	30,185,354.09	4.89
61	600149	廊坊发展	30,149,972.50	4.88
62	300008	天海防务	30,004,023.78	4.86
63	002153	石基信息	29,666,682.42	4.81
64	300165	天瑞仪器	29,466,611.58	4.77
65	300202	聚龙股份	29,465,701.66	4.77
66	300422	博世科	29,379,352.27	4.76
67	300468	四方精创	29,329,035.94	4.75
68	000937	冀中能源	29,308,065.79	4.75
69	600809	山西汾酒	29,181,826.27	4.73
70	002271	东方雨虹	29,148,384.96	4.72
71	600476	湘邮科技	28,821,734.23	4.67
72	600645	中源协和	28,627,274.20	4.64
73	000801	四川九洲	28,623,429.07	4.64
74	002425	凯撒股份	28,491,132.26	4.62
75	000881	大连国际	28,223,872.26	4.57
76	002530	丰东股份	27,753,700.00	4.50
77	300230	永利股份	27,644,806.80	4.48
78	002179	中航光电	27,036,565.03	4.38
79	600584	长电科技	26,743,844.55	4.33
80	300386	飞天诚信	26,465,712.20	4.29
81	601233	桐昆股份	26,204,086.27	4.24
82	002313	日海通讯	26,050,634.00	4.22
83	000889	茂业通信	25,959,341.88	4.21
84	600458	时代新材	25,382,168.56	4.11
85	002667	鞍重股份	25,326,791.85	4.10
86	300263	隆华节能	25,240,677.48	4.09
87	002609	捷顺科技	25,063,250.32	4.06
88	300493	润欣科技	24,692,069.76	4.00
89	300465	高伟达	24,296,848.00	3.94
90	000948	南天信息	24,272,908.60	3.93
91	600661	新南洋	24,201,824.19	3.92
92	600686	金龙汽车	24,136,112.49	3.91

93	603869	北部湾旅	24,117,233.50	3.91
94	002626	金达威	23,998,594.07	3.89
95	300364	中文在线	23,913,784.00	3.87
96	300373	扬杰科技	23,882,370.54	3.87
97	300444	双杰电气	23,814,828.00	3.86
98	300156	神雾环保	23,765,252.74	3.85
99	002405	四维图新	23,710,352.99	3.84
100	600273	嘉化能源	23,699,088.00	3.84
101	002462	嘉事堂	23,638,212.97	3.83
102	600161	天坛生物	23,606,900.07	3.82
103	000686	东北证券	23,473,783.00	3.80
104	002529	海源机械	23,335,080.76	3.78
105	000700	模塑科技	23,323,565.16	3.78
106	000911	南宁糖业	23,297,567.07	3.77
107	002649	博彦科技	23,271,963.65	3.77
108	002053	云南盐化	23,112,261.62	3.74
109	000021	深科技	23,100,169.20	3.74
110	600657	信达地产	22,837,504.82	3.70
111	600110	诺德股份	22,799,533.00	3.69
112	002538	司尔特	22,697,182.95	3.68
113	002157	正邦科技	22,463,932.12	3.64
114	002746	仙坛股份	22,460,166.49	3.64
115	000938	紫光股份	22,350,393.80	3.62
116	603108	润达医疗	22,267,536.30	3.61
117	300113	顺网科技	22,250,750.65	3.60
118	300375	鹏翎股份	21,728,344.92	3.52
119	002357	富临运业	21,396,672.22	3.47
120	000975	银泰资源	21,338,631.26	3.46
121	600563	法拉电子	20,758,213.70	3.36
122	002434	万里扬	20,692,897.94	3.35
123	000531	穗恒运A	20,170,968.00	3.27
124	600730	中国高科	19,657,397.30	3.18
125	002137	麦达数字	19,444,198.30	3.15
126	300109	新开源	19,353,032.80	3.13
127	300136	信维通信	18,285,745.82	2.96
128	002670	华声股份	18,062,871.76	2.93

129	600460	士兰微	17,958,885.59	2.91
130	002409	雅克科技	17,710,027.20	2.87
131	601799	星宇股份	17,461,016.66	2.83
132	002383	合众思壮	17,277,287.04	2.80
133	600869	智慧能源	17,183,881.50	2.78
134	002260	德奥通航	16,662,108.05	2.70
135	000545	金浦钛业	16,623,790.12	2.69
136	000687	华讯方舟	16,548,519.55	2.68
137	300150	世纪瑞尔	16,407,124.97	2.66
138	300155	安居宝	16,299,737.38	2.64
139	000733	振华科技	16,254,066.28	2.63
140	600295	鄂尔多斯	16,120,356.38	2.61
141	002643	万润股份	16,017,486.84	2.59
142	600990	四创电子	15,864,863.31	2.57
143	002714	牧原股份	15,852,550.84	2.57
144	600536	中国软件	15,769,457.90	2.55
145	600967	北方创业	15,741,553.17	2.55
146	600382	广东明珠	15,673,998.62	2.54
147	002553	南方轴承	15,358,918.28	2.49
148	300306	远方光电	15,345,221.00	2.49
149	002103	广博股份	15,341,260.63	2.49
150	600802	福建水泥	15,116,338.70	2.45
151	300021	大禹节水	15,082,034.42	2.44
152	002709	天赐材料	14,741,091.85	2.39
153	600305	恒顺醋业	14,712,107.12	2.38
154	600137	浪莎股份	14,668,925.71	2.38
155	603899	晨光文具	14,582,614.95	2.36
156	002582	好想你	14,529,640.13	2.35
157	002318	久立特材	14,465,209.44	2.34
158	300130	新国都	14,322,150.00	2.32
159	601607	上海医药	14,268,881.55	2.31
160	600988	赤峰黄金	14,264,957.00	2.31
161	000606	*ST 易桥	13,795,844.14	2.23
162	300331	苏大维格	13,701,403.10	2.22
163	600315	上海家化	13,567,826.16	2.20
164	002303	美盈森	13,511,089.75	2.19

165	600690	青岛海尔	13,142,557.00	2.13
166	600597	光明乳业	13,123,660.37	2.13
167	300014	亿纬锂能	12,997,698.21	2.11
168	300322	硕贝德	12,869,784.36	2.08
169	002077	大港股份	12,532,429.36	2.03
170	002127	南极电商	12,523,457.00	2.03
171	603508	思维列控	12,417,033.49	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300078	思创医惠	128,747,842.22	20.86
2	002655	共达电声	82,962,429.52	13.44
3	300342	天银机电	79,253,061.47	12.84
4	300098	高新兴	75,005,899.59	12.15
5	603398	邦宝益智	70,912,425.12	11.49
6	601398	工商银行	67,738,163.30	10.97
7	300467	迅游科技	64,572,125.78	10.46
8	002094	青岛金王	63,963,518.55	10.36
9	300178	腾邦国际	63,137,605.25	10.23
10	300009	安科生物	61,894,925.95	10.03
11	002662	京威股份	60,807,359.67	9.85
12	002730	电光科技	59,574,088.48	9.65
13	002050	三花股份	55,569,069.10	9.00
14	000526	紫光学大	55,452,408.65	8.98
15	002537	海立美达	53,915,525.12	8.73
16	002624	完美环球	52,174,495.39	8.45
17	300109	新开源	51,643,831.52	8.37
18	300395	菲利华	51,477,075.49	8.34
19	300236	上海新阳	51,325,900.48	8.31
20	002668	奥马电器	49,292,797.63	7.98
21	000581	威孚高科	48,293,972.26	7.82
22	601689	拓普集团	48,030,678.31	7.78
23	600386	北巴传媒	46,872,684.89	7.59
24	600198	大唐电信	46,382,125.99	7.51
25	002235	安妮股份	45,795,588.57	7.42

26	300377	赢时胜	45,239,474.17	7.33
27	002343	慈文传媒	44,870,495.90	7.27
28	300263	隆华节能	43,795,033.99	7.09
29	002245	澳洋顺昌	43,596,142.35	7.06
30	300018	中元股份	43,494,850.14	7.05
31	300166	东方国信	43,289,840.30	7.01
32	600826	兰生股份	43,123,601.31	6.99
33	000810	创维数字	43,063,815.51	6.98
34	300384	三联虹普	41,835,797.50	6.78
35	603601	再升科技	40,627,036.24	6.58
36	000779	三毛派神	39,578,981.50	6.41
37	002664	信质电机	39,446,437.38	6.39
38	600958	东方证券	39,305,118.24	6.37
39	002032	苏泊尔	38,896,013.47	6.30
40	300183	东软载波	38,198,136.62	6.19
41	000925	众合科技	37,392,419.52	6.06
42	002264	新华都	37,261,074.40	6.04
43	600547	山东黄金	37,224,514.64	6.03
44	600235	民丰特纸	36,913,091.69	5.98
45	300304	云意电气	36,646,718.52	5.94
46	002667	鞍重股份	36,395,319.68	5.90
47	002153	石基信息	34,980,419.16	5.67
48	300339	润和软件	34,208,388.16	5.54
49	600809	山西汾酒	33,441,317.57	5.42
50	300047	天源迪科	32,124,245.18	5.20
51	300224	正海磁材	31,926,821.96	5.17
52	300011	鼎汉技术	31,712,852.59	5.14
53	300396	迪瑞医疗	31,505,868.23	5.10
54	300468	四方精创	31,017,084.98	5.02
55	300033	同花顺	30,750,212.50	4.98
56	600306	*ST 商城	30,477,735.64	4.94
57	002271	东方雨虹	30,274,301.04	4.90
58	002425	凯撒股份	30,112,618.74	4.88
59	000892	星美联合	30,109,046.47	4.88
60	600990	四创电子	29,893,628.07	4.84
61	600645	中源协和	29,816,313.72	4.83
62	000657	中钨高新	29,249,948.25	4.74
63	600584	长电科技	29,186,003.25	4.73

64	002587	奥拓电子	28,932,627.41	4.69
65	000937	冀中能源	28,887,742.97	4.68
66	002239	奥特佳	28,831,316.56	4.67
67	002530	丰东股份	28,687,951.32	4.65
68	300241	瑞丰光电	28,630,345.50	4.64
69	300202	聚龙股份	28,530,466.56	4.62
70	300373	扬杰科技	28,218,620.02	4.57
71	300165	天瑞仪器	27,965,702.00	4.53
72	000070	特发信息	27,485,450.83	4.45
73	300008	天海防务	27,450,219.12	4.45
74	002179	中航光电	27,342,867.13	4.43
75	000801	四川九洲	27,285,032.06	4.42
76	300422	博世科	27,209,676.11	4.41
77	600458	时代新材	26,532,820.12	4.30
78	601233	桐昆股份	26,475,889.99	4.29
79	300386	飞天诚信	26,317,580.82	4.26
80	000881	大连国际	26,105,977.16	4.23
81	300230	永利股份	25,982,772.64	4.21
82	002626	金达威	25,899,566.97	4.20
83	600476	湘邮科技	25,639,154.94	4.15
84	300493	润欣科技	25,280,721.22	4.10
85	000889	茂业通信	25,232,927.03	4.09
86	300113	顺网科技	25,169,425.42	4.08
87	002053	云南盐化	24,731,314.57	4.01
88	000948	南天信息	24,729,619.80	4.01
89	603268	松发股份	24,561,543.20	3.98
90	300101	振芯科技	24,232,639.74	3.93
91	002649	博彦科技	24,078,880.73	3.90
92	600686	金龙汽车	24,021,588.70	3.89
93	002313	日海通讯	23,898,640.71	3.87
94	000531	穗恒运A	23,264,419.70	3.77
95	603869	北部湾旅	23,099,756.00	3.74
96	600161	天坛生物	22,827,765.56	3.70
97	000686	东北证券	22,805,738.26	3.69
98	300444	双杰电气	22,565,997.64	3.66
99	600273	嘉化能源	22,334,565.74	3.62
100	600661	新南洋	22,269,810.75	3.61
101	000911	南宁糖业	22,209,744.38	3.60

102	300364	中文在线	22,088,984.51	3.58
103	002405	四维图新	21,667,004.54	3.51
104	300196	长海股份	21,636,209.91	3.50
105	000938	紫光股份	21,615,359.65	3.50
106	002357	富临运业	21,196,099.73	3.43
107	600657	信达地产	21,065,611.89	3.41
108	002409	雅克科技	21,004,466.41	3.40
109	002538	司尔特	20,879,817.97	3.38
110	000700	模塑科技	20,632,663.72	3.34
111	002134	天津普林	20,623,644.76	3.34
112	002746	仙坛股份	20,543,346.14	3.33
113	002157	正邦科技	20,418,808.39	3.31
114	000333	美的集团	20,397,533.21	3.30
115	000975	银泰资源	20,080,165.26	3.25
116	600563	法拉电子	20,042,362.82	3.25
117	000985	大庆华科	19,275,796.69	3.12
118	300465	高伟达	19,257,754.77	3.12
119	600460	士兰微	19,202,815.00	3.11
120	002137	麦达数字	19,017,311.57	3.08
121	603108	润达医疗	18,498,139.90	3.00
122	000590	启迪古汉	18,282,165.76	2.96
123	600730	中国高科	18,191,695.53	2.95
124	600122	宏图高科	17,925,318.00	2.90
125	002670	华声股份	17,566,030.96	2.85
126	600520	*ST中发	17,342,748.25	2.81
127	300153	科泰电源	17,332,791.92	2.81
128	002383	合众思壮	17,330,814.07	2.81
129	601799	星宇股份	16,569,065.00	2.68
130	600869	智慧能源	16,413,324.69	2.66
131	300130	新国都	16,154,299.38	2.62
132	300155	安居宝	16,001,798.84	2.59
133	603318	派思股份	15,895,651.48	2.57
134	000687	华讯方舟	15,851,666.00	2.57
135	600536	中国软件	15,815,513.56	2.56
136	300150	世纪瑞尔	15,512,438.04	2.51
137	000733	振华科技	15,508,278.10	2.51
138	002582	好想你	15,467,895.92	2.51
139	002260	德奥通航	15,222,636.90	2.47

140	600382	广东明珠	15,200,233.64	2.46
141	002103	广博股份	15,111,570.64	2.45
142	600967	北方创业	15,038,110.08	2.44
143	600295	鄂尔多斯	15,011,408.56	2.43
144	600305	恒顺醋业	14,839,455.24	2.40
145	002709	天赐材料	14,789,501.30	2.40
146	002643	万润股份	14,664,411.08	2.38
147	000545	金浦钛业	14,656,479.26	2.37
148	600802	福建水泥	14,594,518.15	2.36
149	002714	牧原股份	14,536,912.61	2.35
150	000606	*ST 易桥	14,292,781.10	2.32
151	300503	昊志机电	14,171,849.76	2.30
152	300014	亿纬锂能	14,149,917.00	2.29
153	600988	赤峰黄金	14,149,499.39	2.29
154	601607	上海医药	14,100,672.37	2.28
155	002077	大港股份	14,080,990.04	2.28
156	603899	晨光文具	13,994,564.80	2.27
157	002318	久立特材	13,974,322.41	2.26
158	300326	凯利泰	13,556,063.00	2.20
159	002303	美盈森	13,425,424.60	2.17
160	600690	青岛海尔	13,225,058.00	2.14
161	600315	上海家化	13,170,140.83	2.13
162	300021	大禹节水	13,052,066.75	2.11
163	300331	苏大维格	12,663,863.43	2.05
164	002127	南极电商	12,654,503.48	2.05
165	300306	远方光电	12,605,712.00	2.04
166	300359	全通教育	12,446,347.76	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,464,950,962.61
卖出股票收入（成交）总额	5,353,394,228.67

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，无投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,215,006.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,576.86
5	应收申购款	107,505.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,346,088.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600149	廊坊发展	33,017,570.00	5.56	临时停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
24,762	13,044.90	111,324,889.95	34.46%	211,692,840.44	65.54%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	广东证券股份有限公司	6,000,000.00	4.42%
2	中经信投资有限公司	5,170,000.00	3.81%
3	联想投资有限公司	2,131,200.00	1.57%
4	徐惠清	1,300,600.00	0.96%
5	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,211,853.00	0.89%
6	黄城	1,143,000.00	0.84%
7	上海协通(集团)有限公司	1,032,300.00	0.76%
8	金宗义	1,000,020.00	0.74%
9	欧阳艳芬	1,000,000.00	0.74%
10	曹素清	642,800.00	0.47%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	28,434.45	0.0088%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年4月10日)基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	273,326,407.00
本报告期基金总申购份额	220,297,503.91
减：本报告期基金总赎回份额	170,606,180.52
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	323,017,730.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过，钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

10.7 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	
光大证券		22,160,736,935.64	19.97%	1,969,109.48	19.96%	-
长江证券		11,090,399,087.96	10.08%	993,667.99	10.07%	-

申银万国	1	957,693,668.95	8.85%	872,756.07	8.85%	-
安信证券	2	921,620,549.92	8.52%	842,144.46	8.54%	-
国信证券	1	568,395,402.90	5.25%	517,981.53	5.25%	-
渤海证券	2	567,342,519.61	5.24%	517,022.84	5.24%	-
国泰君安	1	550,196,679.77	5.09%	501,412.65	5.08%	-
东方证券	1	505,159,357.90	4.67%	460,863.17	4.67%	-
万联证券	1	493,388,339.35	4.56%	449,634.87	4.56%	-
招商证券	2	475,299,548.97	4.39%	433,149.83	4.39%	-
华泰证券	2	434,766,037.65	4.02%	396,206.45	4.02%	-
华林证券	1	350,180,100.89	3.24%	319,122.87	3.24%	-
方正证券	1	290,499,601.45	2.69%	264,734.30	2.68%	-
广发证券	1	289,842,124.48	2.68%	264,126.76	2.68%	-
中投证券	3	265,449,451.37	2.45%	241,903.44	2.45%	-
恒泰证券	1	185,084,393.95	1.71%	168,670.35	1.71%	-
东吴证券	1	163,767,214.54	1.51%	149,244.26	1.51%	-
海通证券	2	147,044,831.87	1.36%	136,942.45	1.39%	-
西南证券	1	123,424,787.63	1.14%	112,480.44	1.14%	-
长城证券	1	108,465,051.67	1.00%	98,848.45	1.00%	-
湘财证券	1	75,991,961.70	0.70%	69,252.23	0.70%	-
江海证券	1	71,169,178.43	0.66%	64,854.60	0.66%	-
平安证券	1	14,309,813.58	0.13%	13,040.64	0.13%	-
中信证券	2	7,763,080.51	0.07%	7,074.65	0.07%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	-	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：恒泰证券、方正证券、平安证券。

本报告期内退租交易单元：无。

10.8 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	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)2015年第4季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月20日
2	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加中国农业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	2016年1月23日
3	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)2015年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月26日
4	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)2015年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月26日
5	大成基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定报	2016年3月29日

	长沙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	刊及本公司网站	
6	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	2016年4月15日
7	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)2016年第1季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月22日
8	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	2016年5月5日
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	2016年5月10日
10	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2016年第1期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月25日
11	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2016年第1期)-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年5月25日
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	2016年6月14日
13	大成基金关于旗下部分基金增加汉口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	2016年6月25日
14	关于大成基金管理有限公司在京东商城基金直销店铺开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年6月29日
15	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月5日
16	关于旗下场内基金在指数熔断期	中国证监会指定报	2016年1月6日

	间暂停申购赎回业务的提示性公告	刊及本公司网站	
17	大成基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分公募基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月8日
18	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	2016年1月18日
19	大成基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年1月30日
20	大成基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年2月18日
21	大成基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众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	2016年2月27日
22	大成基金管理有限公司关于增加北京葱次方资产管理有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月1日
23	大成基金管理有限公司关于增加徽商期货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	2016年3月12日
24	关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月17日

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	2016年3月18日
26	大成基金管理有限公司关于增加万和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	2016年3月26日
27	关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年3月29日
28	大成基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月18日
29	大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016年4月27日
30	大成基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务(深圳)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	2016年4月30日
31	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京钱景财富投资管理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	2016年5月5日
32	大成基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子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	2016年5月5日
33	大成基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富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	2016年5月7日

34	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买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	2016 年 5 月 10 日
35	大成基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉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	2016 年 5 月 17 日
36	大成基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）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	2016 年 6 月 22 日
37	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	2016 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 4 月 27 日《大成基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告》，根据大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第十四次会议和 2016 年第一次临时股东会的有关决议，本公司原股东广东证券股份有限公司通过其破产管理人将所持本公司 2% 股权（对应出资额 400 万元）以拍卖竞买的方式转让给本公司股东中泰信托有限责任公司，广东证券股份有限公司退出本公司投资，中泰信托有限责任公司所持本公司股权增至 50%（对应出资额 1 亿元），同时，就本公司股权变更的相关内容修改《大成基金管理有限公司公司章程》。本公司股权变更及修改《大成基金管理有限公司公司章程》的工商变更手续已于 2016 年 4 月 25 日在深圳市市场监督管理局办理完毕。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）的文件；
- 2、《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

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

12.2 存放地点

本报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司
2016年8月25日