

大成价值增长证券投资基金
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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 其他指标.....	8
§ 4 管理人报告	8
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43

7.12 投资组合报告附注.....	43
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§ 9 开放式基金份额变动.....	45
§ 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.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成价值增长证券投资基金
基金简称	大成价值增长混合
基金主代码	090001
前端交易代码	090001
后端交易代码	091001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 11 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	2,810,880,023.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以价值增长类股票为主构造投资组合，在有效分散投资风险的基础上，通过资产配置和投资组合的动态调整，达到超过市场的风险收益比之目标，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：资产配置和行业配置遵循自上而下的积极策略，个股选择遵循自下而上的积极策略。本基金的股票投资重点关注：低 P/B 值、具有可持续增长潜力、盈利水平超过行业平均水平、具有核心竞争力的优势企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%。

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	北京市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 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	周慕冰

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》、《证券日报》
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	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	-117,838,139.94
本期利润	-238,096,560.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0870
本期加权平均净值利润率	-9.77%
本期基金份额净值增长率	-6.59%
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	-253,561,649.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0902
期末基金资产净值	2,557,318,374.29
期末基金份额净值	0.9098
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	630.93%

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）。

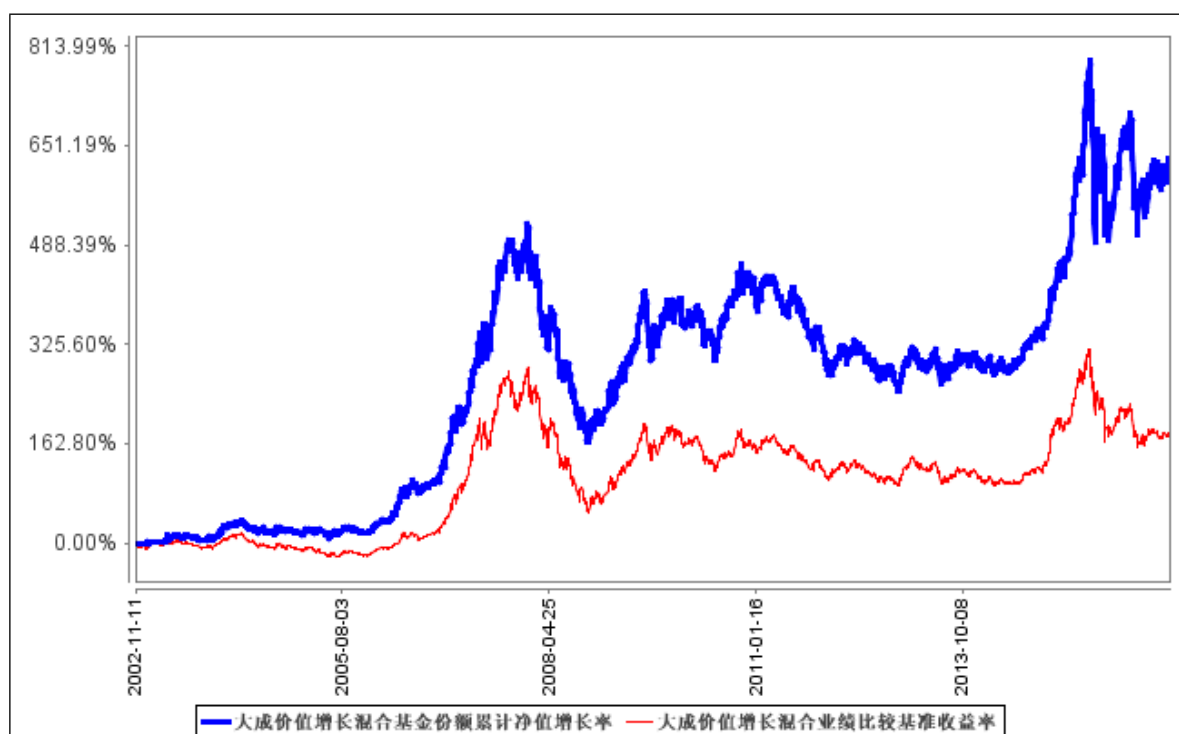
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.99%	1.05%	-0.24%	0.78%	3.23%	0.27%
过去三个月	3.79%	1.19%	-1.47%	0.81%	5.26%	0.38%
过去六个月	-6.59%	1.89%	-12.01%	1.47%	5.42%	0.42%
过去一年	-4.98%	2.31%	-23.03%	1.84%	18.05%	0.47%
过去三年	97.01%	1.67%	39.11%	1.47%	57.90%	0.20%
自基金合同生效起至今	630.93%	1.40%	179.61%	1.45%	451.32%	-0.05%

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、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同规定。

2、本基金业绩比较基准自 2008 年 3 月 1 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中信标普国债指数×20%，自 2015 年 9 月 14 日起变更为：沪深 300 指数×80%+中债综合指数×20%，本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从 2002 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2008 年 2 月 29 日为原

业绩比较基准（中信价值指数×80%+中信国债指数×20%）的走势，2008年3月1日至2015年9月13日为业绩比较基准（沪深300指数×80%+中信标普国债指数×20%）的走势，2015年9月14日起为变更后的业绩比较基准（沪深300指数×80%+中债综合指数×20%）的走势。

§ 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		
石国武先生	本基金基金经理	2013 年 4 月 18 日	-	14 年	工学硕士。2002 年 12 月至 2012 年 11 月就职于博时基金管理有限公司，历任系统分析员、股票投资部投资经理助理，特定资产部投资经理。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司。2013 年 4 月 18 日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。2014 年 8 月 23 日至 2015 年 7 月 21 日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日至 2016 年 3 月 8 日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 18 日至 2015 年 7 月 23 日担任大成优选股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2015 年 7 月 24 日至 2016 年 5

					<p>月 25 日任大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 9 月 23 日起任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 19 日起任大成定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日起任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。现任股票投资部价值组投资总监。具有基金从业资格。国籍: 中国</p>
--	--	--	--	--	---

注: 1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成价值增长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, 大成价值增长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 年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

2016 年上半年，沪深 300 下跌为 15.47%，创业板指数下跌为 17.92%，在经历 2015 年四季度市场显著反弹后，股票市场在年初赢来极为惨淡的开局，新推出的熔断机制加剧了市场的恐慌效应。随着管理层对资本市场维稳政策的逐步推出，以及市场下跌动能释放，市场进入逐步震荡走稳，板块和个股结构性机会成为市场参与主体关注的焦点，并带来市场人气逐步回升。

基金组合资产配置比例保持稳定，组合持仓集中度提升，秉持一贯根据风险收益比调整组合结构的策略持续对组合结构和品种进行优化，组合表现符合投资管理人的预期。

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 0.9098 元。本报告期内基金份额净值增长率为-6.59%，同期业绩比较基准收益率-12.01%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，中央政府的经济重心是在维持经济稳定增长的前提下着力推进供给侧结构性改革，我们预计宏观经济景气将会保持稳定，财政政策力度加大，货币政策继续保持宽松环境。资本市场在上半年大幅震荡之后，市场走势倾向平稳，结合经济表现和改革进展，我们预计资本市场震荡走势的格局依然会得以保持，潜在可能打破震荡格局的因素我们观察点在于经济改革的实质性落地和金融市场内部在风险化解过程中的稳定性。

我们的投资策略将继续坚持淡化仓位配置的影响，聚焦于产业和企业层面，寻找未来产业趋势变迁中的受益者和企业竞争中的优胜者，我们相信，与优势企业共进是帮助投资者在经济低迷中获取合理回报的可靠途径，并将在未来的经济环境中更加明显。在全球低利率环境长期保持的

背景下，我们看好优质上市公司股权的价值。

组合投资上，大成价值增长资产配置将保持稳定，根据产业和企业的跟踪研究，风险收益比的动态衡量优化组合配置，降低组合换手率，力争为持有人获取合理回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内已分配利润 696,664,498.68 元（每十份基金份额分红 2.987 元），符合基金合同规定的分红比例。

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合规守信情况声明

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一大成基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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合规守信、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半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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	213,713,979.47	230,887,282.86
结算备付金		6,440,861.14	13,977,632.35
存出保证金		1,978,745.46	4,088,565.03

交易性金融资产	6.4.3.2	2,525,360,427.69	3,301,686,091.68
其中：股票投资		1,938,541,985.19	2,248,211,540.18
基金投资		-	-
债券投资		586,818,442.50	1,053,474,551.50
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		-	20,135,953.82
应收利息	6.4.3.5	9,508,390.46	21,811,791.45
应收股利		-	-
应收申购款		141,901.82	224,228.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,757,144,306.04	3,592,811,545.71
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		100,000,000.00	498,998,851.50
应付证券清算款		87,443,571.61	-
应付赎回款		4,622,060.49	5,345,639.67
应付管理人报酬		3,074,920.19	3,967,390.01
应付托管费		512,486.69	661,231.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	3,650,692.10	7,468,794.09
应交税费		-	-
应付利息		76,196.90	558,874.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	446,003.77	280,083.04
负债合计		199,825,931.75	517,280,863.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	2,810,880,023.61	2,309,211,183.72
未分配利润	6.4.3.10	-253,561,649.32	766,319,498.01
所有者权益合计		2,557,318,374.29	3,075,530,681.73
负债和所有者权益总计		2,757,144,306.04	3,592,811,545.71

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9098 元，基金份额总额 2,810,880,023.61 份。

6.2 利润表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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		-202,608,542.18	2,817,305,434.42
1. 利息收入		8,675,476.40	30,222,650.91
其中：存款利息收入	6.4.3.11	713,420.57	2,304,144.03
债券利息收入		7,960,744.81	27,825,995.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,311.02	92,511.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-91,137,956.32	3,102,553,992.70
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-109,729,107.86	2,931,042,522.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-225,036.02	137,050,823.93
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-	-
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	18,816,187.56	34,460,646.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-120,258,420.30	-319,631,886.49
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	112,358.04	4,160,677.30
减：二、费用		35,488,018.06	103,131,444.92
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	18,154,196.31	47,852,947.38
2. 托管费	6.4.6.2.2	3,025,699.40	7,975,491.21
3. 交易费用	6.4.3.19	12,065,753.27	28,225,471.08
4. 利息支出		1,942,514.80	18,744,253.48
其中：卖出回购金融资产支出		1,942,514.80	18,744,253.48
5. 其他费用	6.4.3.20	299,854.28	333,281.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-238,096,560.24	2,714,173,989.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-238,096,560.24	2,714,173,989.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成价值增长证券投资基金

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)	2,309,211,183.72	766,319,498.01	3,075,530,681.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-238,096,560.24	-238,096,560.24
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)	501,668,839.89	-85,120,088.41	416,548,751.48
其中：1. 基金申购款	698,573,126.84	-102,273,327.28	596,299,799.56
2. 基金赎回款	-196,904,286.95	17,153,238.87	-179,751,048.08
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)	-	-696,664,498.68	-696,664,498.68
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,810,880,023.61	-253,561,649.32	2,557,318,374.29
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	8,176,803,559.38	-870,549,067.06	7,306,254,492.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,714,173,989.50	2,714,173,989.50
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)	-5,201,624,580.17	-923,217,845.14	-6,124,842,425.31
其中：1. 基金申购款	470,384,560.08	61,410,418.33	531,794,978.41
2. 基金赎回款	-5,672,009,140.25	-984,628,263.47	-6,656,637,403.72
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)	2,975,178,979.21	920,407,077.30	3,895,586,056.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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	213,713,979.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	213,713,979.47

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	1,924,396,772.47	1,938,541,985.19	14,145,212.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	418,204,682.07	415,945,442.50
	银行间市场	169,823,550.00	170,873,000.00
	合计	588,028,232.07	586,818,442.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,512,425,004.54	2,525,360,427.69	12,935,423.15

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工具。

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	30,528.35

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	2,608.56
应收债券利息	9,474,452.19
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	801.36
合计	9,508,390.46

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	3,650,277.10
银行间市场应付交易费用	415.00
合计	3,650,692.10

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	-
应付赎回费	9,967.09
预提费用	436,036.68
其他	-
合计	446,003.77

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	2,309,211,183.72	2,309,211,183.72
本期申购	698,573,126.84	698,573,126.84
本期赎回（以“-”号填列）	-196,904,286.95	-196,904,286.95
本期末	2,810,880,023.61	2,810,880,023.61

注：申购含红利再投份额。

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	1,558,692,167.22	-792,372,669.21	766,319,498.01
本期利润	-117,838,139.94	-120,258,420.30	-238,096,560.24
本期基金份额交易产生的变动数	182,781,601.32	-267,901,689.73	-85,120,088.41
其中：基金申购款	253,771,963.78	-356,045,291.06	-102,273,327.28
基金赎回款	-70,990,362.46	88,143,601.33	17,153,238.87
本期已分配利润	-696,664,498.68	-	-696,664,498.68
本期末	926,971,129.92	-1,180,532,779.24	-253,561,649.32

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	608,185.01
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	76,282.80
其他	28,952.76
合计	713,420.57

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	4,046,025,222.56
减：卖出股票成本总额	4,155,754,330.42
买卖股票差价收入	-109,729,107.86

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-225,036.02
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	-225,036.02
----	-------------

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	637,032,667.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	618,391,126.53
减：应收利息总额	18,866,576.92
买卖债券差价收入	-225,036.02

6.4.3.14 贵金属投资收益

6.4.3.14.1 贵金属投资收益项目构成

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	18,816,187.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,816,187.56

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	-120,258,420.30
——股票投资	-116,558,467.46
——债券投资	-3,699,952.84
——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	-120,258,420.30

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	109,297.59
基金转换费收入	3,060.45
合计	112,358.04

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	12,063,828.27
银行间市场交易费用	1,925.00
合计	12,065,753.27

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	77,077.00
信息披露费	188,959.68
其他	700.00
上清所债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	15,117.60
中债登债券托管账户维护费	9,000.00
合计	299,854.28

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**

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司（“广东证券”）	基金管理人的股东（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 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	
	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	1,577,882,321.59	19.71%	2,102,120,100.17	12.56%

6.4.6.1.2 债券交易

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		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
光大证券	105,055,444.62	67.21%	-	0.00%

6.4.6.1.3 债券回购交易

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		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例

光大证券	12,000,000.00	0.68%	-	0.00%
------	---------------	-------	---	-------

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,437,941.87	19.69%	326,188.79	8.94%
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	1,868,207.91	12.48%	1,337,649.12	16.66%

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

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	18,154,196.31	47,852,947.38
其中：支付销售机构的客户维护费	2,841,911.93	7,529,105.03

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

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托管费	3,025,699.40	7,975,491.21
----------------	--------------	--------------

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。

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

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	420,000,000.00	183,975.34
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	309,700,000.00	570,851.95

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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

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
中国农业银行	213,713,979.47	608,185.01	623,505,560.45	2,184,131.16

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。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2016/1/22	2016/1/22	2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	
合计	-		2.9870	368,343,854.02	328,320,644.66	696,664,498.68	

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016/06/24	2016/07/06	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016/06/23	2016/07/01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016/06/30	2016/07/08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016/06/29	2016/07/07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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
600497	驰宏锌锗	2016/06/09	重大事项	9.97	2016/7/11	10.97	1,587,045	16,206,418.97	15,822,838.65	-
002065	东华软件	2015/12/21	重大事项	25.10	2016/7/4	22.43	4,600	100,492.00	115,460.00	-
300299	富春通信	2016/03/01	重大事项	27.51	-	-	123	4,931.85	3,383.73	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000,000 元，于 2016 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在正回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于高风险品种。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实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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，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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国农业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.94%（2015 年 12 月 31 日：0.15%）。

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 6.4.8 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 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 100,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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、存出保证金及债券投资等。

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	213,713,979.47	-	-	-	213,713,979.47
结算备付金	6,440,861.14	-	-	-	6,440,861.14
存出保证金	1,978,745.46	-	-	-	1,978,745.46
交易性金融资产	503,564,038.50	50,825,000.00	32,429,404.00	1,938,541,985.19	2,525,360,427.69
应收利息	-	-	-	9,508,390.46	9,508,390.46
应收申购款	-	-	-	141,901.82	141,901.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	725,697,624.57	50,825,000.00	32,429,404.00	1,948,192,277.47	2,757,144,306.04
负债					

卖出回购金融资产款	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	87,443,571.61	87,443,571.61
应付赎回款	-	-	-	4,622,060.49	4,622,060.49
应付管理人报酬	-	-	-	3,074,920.19	3,074,920.19
应付托管费	-	-	-	512,486.69	512,486.69
应付交易费用	-	-	-	3,650,692.10	3,650,692.10
应付利息	-	-	-	76,196.90	76,196.90
其他负债	-	-	-	446,003.77	446,003.77
负债总计	100,000,000.00	-	-	99,825,931.75	199,825,931.75
利率敏感度缺口	625,697,624.57	50,825,000.00	32,429,404.00	1,848,366,345.72	2,557,318,374.29
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	230,887,282.86	-	-	-	230,887,282.86
结算备付金	13,977,632.35	-	-	-	13,977,632.35
存出保证金	4,088,565.03	-	-	-	4,088,565.03
交易性金融资产	964,938,330.00	51,290,000.00	37,246,221.50	2,248,211,540.18	3,301,686,091.68
应收证券清算款	-	-	-	20,135,953.82	20,135,953.82
应收利息	-	-	-	21,811,791.45	21,811,791.45
应收申购款	1,988.07	-	-	222,240.45	224,228.52
资产总计	1,213,893,798.31	51,290,000.00	37,246,221.50	2,290,381,525.90	3,592,811,545.71
负债					
卖出回购金融资产款	498,998,851.50	-	-	-	498,998,851.50
应付赎回款	-	-	-	5,345,639.67	5,345,639.67
应付管理人报酬	-	-	-	3,967,390.01	3,967,390.01
应付托管费	-	-	-	661,231.64	661,231.64
应付交易费用	-	-	-	7,468,794.09	7,468,794.09
应付利息	-	-	-	558,874.03	558,874.03
其他负债	-	-	-	280,083.04	280,083.04
负债总计	498,998,851.50	-	-	18,282,012.48	517,280,863.98
利率敏感度缺口	714,894,946.81	51,290,000.00	37,246,221.50	2,272,099,513.42	3,075,530,681.73

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予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）	
		本期末 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加 60	增加 128
2. 市场利率上升 25 个基点	减少 59	减少 127	

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”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。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。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	1,938,541,985.19	75.80	2,248,211,540.18	73.10
衍生金融资产—权证投资	—	0.00	—	0.00
其他	—	0.00	—	0.00
合计	1,938,541,985.19	75.80	2,248,211,540.18	73.10

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：人民币万元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
1.	业绩比较基准上升 5%	增加 15,418	增加 15,680
2.	业绩比较基准下降 5%	减少 15,418	减少 15,680

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	1,938,541,985.19	70.31
	其中：股票	1,938,541,985.19	70.31
2	固定收益投资	586,818,442.50	21.28
	其中：债券	586,818,442.50	21.28
	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	220,154,840.61	7.98
7	其他各项资产	11,629,037.74	0.42
8	合计	2,757,144,306.04	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	15,822,838.65	0.62
C	制造业	1,169,585,714.70	45.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,247,241.79	3.29
E	建筑业	18,329,296.12	0.72
F	批发和零售业	225,779,149.41	8.83
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	60,740,455.20	2.38
J	金融业	64,506,127.60	2.52
K	房地产业	107,204,854.68	4.19
L	租赁和商务服务业	98,966,417.36	3.87
M	科学研究和技术服务业	143,926.10	0.01
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	13,195,394.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	52,005,044.00	2.03
S	综合	28,015,525.58	1.10
	合计	1,938,541,985.19	75.80

7.2.2 报告期内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	000910	大亚科技	10,568,907	163,289,613.15	6.39
2	600998	九州通	7,330,551	128,357,948.01	5.02
3	000625	长安汽车	8,652,846	118,284,404.82	4.63
4	600683	京投银泰	11,602,257	107,204,854.68	4.19
5	300058	蓝色光标	10,192,216	98,966,417.36	3.87
6	000860	顺鑫农业	3,093,986	73,574,987.08	2.88
7	002675	东诚药业	1,568,809	72,996,682.77	2.85
8	002013	中航机电	5,266,180	70,988,106.40	2.78
9	600233	大杨创世	3,402,244	66,207,668.24	2.59
10	002142	宁波银行	4,364,420	64,506,127.60	2.52
11	002264	新华都	7,209,508	61,641,293.40	2.41
12	600038	中直股份	1,424,724	59,097,551.52	2.31
13	002597	金禾实业	3,947,111	53,167,585.17	2.08
14	300364	中文在线	1,000,097	52,005,044.00	2.03
15	002267	陕天然气	4,834,771	50,765,095.50	1.99
16	002367	康力电梯	3,291,623	50,690,994.20	1.98

17	600141	兴发集团	3,578,644	41,225,978.88	1.61
18	600718	东软集团	2,139,964	39,204,140.48	1.53
19	600420	现代制药	1,308,215	39,115,628.50	1.53
20	600217	*ST 秦岭	5,000,402	37,903,047.16	1.48
21	601566	九牧王	2,398,291	37,029,613.04	1.45
22	002117	东港股份	1,174,316	36,943,981.36	1.44
23	000078	海王生物	4,815,600	35,779,908.00	1.40
24	002039	黔源电力	1,559,435	29,987,935.05	1.17
25	000881	大连国际	1,269,394	28,015,525.58	1.10
26	600328	兰太实业	2,200,000	26,444,000.00	1.03
27	002308	威创股份	1,499,850	24,642,535.50	0.96
28	000895	双汇发展	1,118,313	23,350,375.44	0.91
29	300224	正海磁材	1,000,024	22,670,544.08	0.89
30	300145	中金环境	1,025,980	22,448,442.40	0.88
31	603168	莎普爱思	499,877	21,994,588.00	0.86
32	600885	宏发股份	702,201	21,564,592.71	0.84
33	002544	杰赛科技	665,637	21,346,978.59	0.83
34	002557	洽洽食品	1,018,253	18,980,235.92	0.74
35	601789	宁波建工	3,037,028	17,554,021.84	0.69
36	601616	广电电气	2,994,700	16,950,002.00	0.66
37	600497	驰宏锌锗	1,587,045	15,822,838.65	0.62
38	300347	泰格医药	454,700	13,195,394.00	0.52
39	300228	富瑞特装	600,000	10,200,000.00	0.40
40	300303	聚飞光电	1,000,000	9,510,000.00	0.37
41	000338	潍柴动力	1,000,000	7,810,000.00	0.31
42	600261	阳光照明	745,000	5,259,700.00	0.21
43	600211	西藏药业	101,323	4,494,688.28	0.18
44	603788	宁波高发	87,481	4,114,231.43	0.16
45	000531	穗恒运 A	285,942	3,494,211.24	0.14
46	600686	金龙汽车	219,894	3,239,038.62	0.13
47	002123	荣信股份	100,000	2,079,000.00	0.08
48	002413	雷科防务	100,000	1,373,000.00	0.05
49	002773	康弘药业	21,815	1,015,488.25	0.04
50	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
51	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
52	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
53	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
54	300012	华测检测	10,000	123,800.00	0.00
55	002065	东华软件	4,600	115,460.00	0.00

56	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
57	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
58	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
59	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
60	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
61	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
62	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
63	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
64	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
65	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
66	300299	富春通信	123	3,383.73	0.00

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	600998	九州通	92,394,574.98	3.00
2	600718	东软集团	85,303,124.91	2.77
3	600233	大杨创世	78,415,461.57	2.55
4	002007	华兰生物	77,448,513.19	2.52
5	600683	京投发展	77,419,943.35	2.52
6	000860	顺鑫农业	77,227,568.11	2.51
7	601799	星宇股份	76,199,674.25	2.48
8	300047	天源迪科	74,866,588.57	2.43
9	600138	XD 中青旅	74,307,496.01	2.42
10	000895	双汇发展	73,372,311.71	2.39
11	300364	中文在线	71,347,853.40	2.32
12	600990	四创电子	70,656,981.35	2.30
13	002597	金禾实业	66,941,313.10	2.18
14	000802	北京文化	65,544,118.44	2.13
15	002675	东诚药业	65,463,620.45	2.13
16	000403	ST 生化	65,395,983.89	2.13
17	300058	蓝色光标	62,343,340.18	2.03
18	600420	现代制药	60,441,056.86	1.97
19	000881	大连国际	57,694,026.67	1.88
20	600547	山东黄金	56,644,214.17	1.84

注：本期累计买入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。

7.4.2 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	601799	星宇股份	121,046,267.22	3.94
2	600138	XD 中青旅	120,618,399.56	3.92
3	600217	秦岭水泥	119,301,246.83	3.88
4	600420	现代制药	119,298,878.99	3.88
5	300059	东方财富	112,213,450.30	3.65
6	002557	洽洽食品	104,265,060.12	3.39
7	600718	东软集团	102,825,362.35	3.34
8	000895	双汇发展	96,989,263.68	3.15
9	002007	华兰生物	86,147,995.43	2.80
10	300047	天源迪科	84,281,808.18	2.74
11	002039	黔源电力	79,384,285.14	2.58
12	300133	华策影视	78,173,932.63	2.54
13	002013	中航机电	76,983,373.81	2.50
14	000403	ST 生化	76,363,539.22	2.48
15	000802	北京文化	74,846,081.27	2.43
16	000881	大连国际	73,973,178.61	2.41
17	600990	四创电子	72,309,743.62	2.35
18	600547	山东黄金	66,975,915.32	2.18
19	300090	盛运环保	66,715,573.64	2.17
20	600887	伊利股份	64,206,231.52	2.09
21	000910	大亚科技	62,739,688.18	2.04

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	3,962,643,242.89
卖出股票收入（成交）总额	4,046,025,222.56

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	340,867,557.10	13.33
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	170,873,000.00	6.68
	其中：政策性金融债	170,873,000.00	6.68
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	75,077,885.40	2.94
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	586,818,442.50	22.95

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019515	15 国债 15	1,584,690	158,453,153.10	6.20
2	019518	15 国债 18	1,500,000	149,985,000.00	5.86
3	123001	蓝标转债	697,102	75,077,885.40	2.94
4	130241	13 国开 41	700,000	70,098,000.00	2.74
5	070215	07 国开 15	500,000	50,825,000.00	1.99

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

本基金本报告期末投资贵金属。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，没有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	1,978,745.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,508,390.46
5	应收申购款	141,901.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,629,037.74

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间的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
149,302	18,826.81	118,980,746.24	4.23%	2,691,899,277.37	95.77%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 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	35,822.26	0.0013%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002年11月11日）基金份额总额	2,604,752,899.89
本报告期期初基金份额总额	2,309,211,183.72
本报告期基金总申购份额	698,573,126.84
减：本报告期基金总赎回份额	196,904,286.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,810,880,023.61

§ 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

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

10.7.1 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	
光大证券	2	1,577,882,321.59	19.71%	1,437,941.87	19.69%	-
中泰证券	1	762,999,744.98	9.53%	695,323.86	9.52%	-
中信建投	2	697,187,493.81	8.71%	635,356.25	8.70%	-
招商证券	2	541,564,872.20	6.76%	493,531.00	6.76%	-
中信证券	2	540,783,990.25	6.75%	492,819.67	6.75%	-
联讯证券	1	432,047,181.88	5.40%	393,728.60	5.39%	-

国泰君安	2	431,015,823.55	5.38%	392,794.26	5.38%	-
华创证券	1	400,658,846.85	5.00%	365,125.15	5.00%	-
海通证券	1	376,523,900.49	4.70%	343,127.15	4.70%	-
中金公司	2	318,328,538.92	3.98%	294,537.01	4.03%	-
瑞银证券	1	305,896,942.57	3.82%	278,766.43	3.82%	-
平安证券	1	302,395,761.62	3.78%	279,153.43	3.82%	-
华泰证券	1	298,402,419.77	3.73%	271,942.68	3.72%	-
兴业证券	2	236,588,614.79	2.95%	215,600.05	2.95%	-
安信证券	1	214,598,713.85	2.68%	195,562.64	2.68%	-
民生证券	1	198,357,719.57	2.48%	180,764.95	2.47%	-
申银万国	1	182,328,279.71	2.28%	166,153.66	2.27%	-
北京高华	1	114,082,302.02	1.42%	103,963.97	1.42%	-
银河证券	4	74,951,957.84	0.94%	68,302.20	0.94%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
爱建证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：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。

本报告期内增加基金交易单元：爱建证券，东方证券，万和证券。本报告期内退租基金交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	105,055,444.62	67.21%	12,000,000.00	0.68%	-	0.00%
中泰证券	30,021,558.20	19.21%	100,000,000.00	5.65%	-	0.00%
中信建投	5,698,007.70	3.65%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	400,000,000.00	22.59%	-	0.00%
联讯证券	11,006,274.25	7.04%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	24,000,000.00	1.36%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	150,000,000.00	8.47%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	50,000,000.00	2.82%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	535,000,000.00	30.21%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	100,000,000.00	5.65%	-	0.00%
银河证券	4,519,303.40	2.89%	400,000,000.00	22.59%	-	0.00%

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	2016/1/12
2	大成价值增长证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/1/20
3	大成价值增长证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/1/20
4	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	2016/3/22
5	大成价值增长证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/3/26
6	大成价值增长证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/3/26
7	大成价值增长证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/4/22
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	2016/5/5
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联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	2016/6/16
10	大成价值增长证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/6/25
11	大成价值增长证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/6/25
12	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	2016/6/25
13	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	2016/1/5
14	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/1/6
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	2016/1/8
16	大成基金管理有限公司关于养老金账	中国证监会指定报刊	2016/1/18

	户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	及本公司网站	
17	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	2016/1/30
18	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	2016/2/18
19	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	2016/2/27
20	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	2016/3/1
21	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	2016/3/12
22	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	2016/3/17
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	2016/3/18
24	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	2016/3/26
25	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	2016/3/29
26	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	2016/4/18
27	大成基金管理来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	2016/4/27
28	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	2016/4/30
29	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	2016/5/5
30	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016/5/5

	基金代销机构并开通相关业务的公告		
31	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	2016/5/7
32	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	2016/5/10
33	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	2016/5/17
34	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	2016/6/22
35	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	2016/6/25

§ 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 年第一次临时股东大会的有关决议，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价值增长证券投资基金的文件；
- 2、《大成价值增长证券投资基金基金合同》；

- 3、《大成价值增长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。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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