

# 大成健康产业混合型证券投资基金

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

<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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
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.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>47</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成健康产业混合型证券投资基金
基金简称	大成健康产业混合
基金主代码	090020
交易代码	090020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 28 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	39,411,617.93 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与健康产业相关的优质上市公司，在控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的主动投资策略。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，实施大类资产配置；通过对健康产业各个子行业发展生命周期、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各个行业的投资价值，实施行业配置；对健康产业各公司在所属行业的竞争优势进行分析，结合股票基本面指标（包括成长性指标和估值指标），精选优质上市公司股票，构建投资组合。为有效控制投资风险，本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资。股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

注：根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票

型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效。

### 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 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	-6,990,709.16
本期利润	-11,377,685.82
加权平均基金份额本期利润	-0.2844
本期加权平均净值利润率	-30.81%
本期基金份额净值增长率	-24.84%
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	-2,557,754.16

期末可供分配基金份额利润	-0.0649
期末基金资产净值	36,853,863.77
期末基金份额净值	0.935
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	-6.50%

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)。

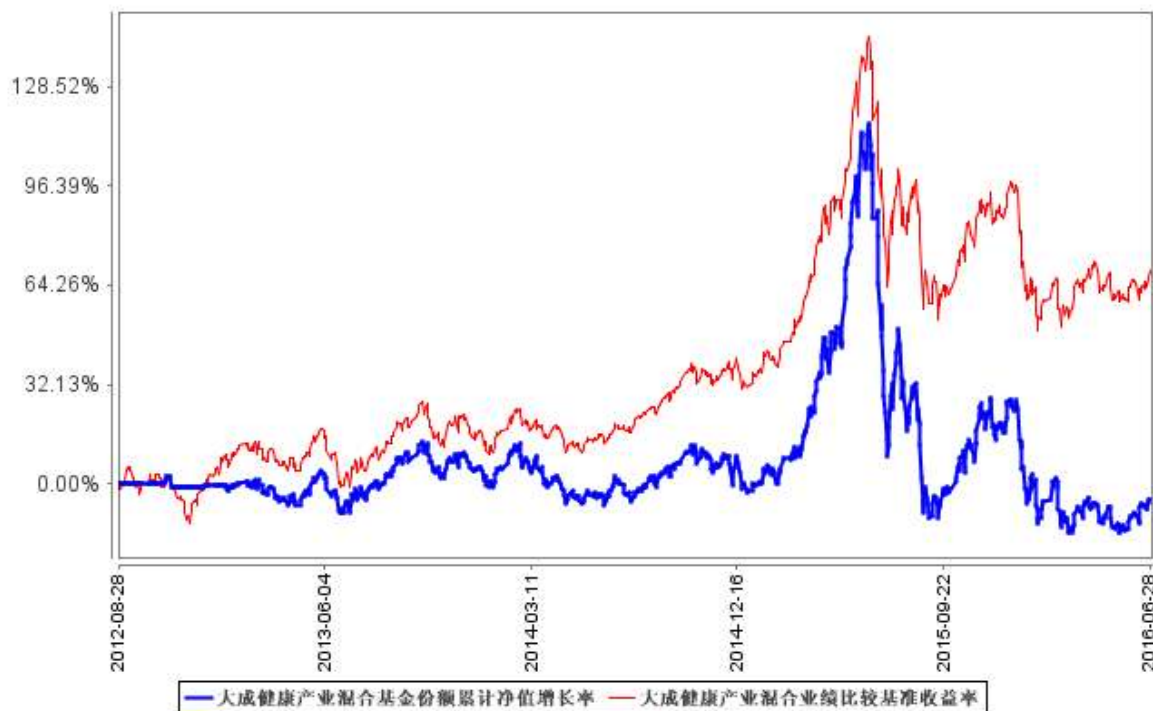
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	6.13%	1.82%	3.46%	1.13%	2.67%	0.69%
过去三个月	-0.64%	1.67%	1.69%	1.21%	-2.33%	0.46%
过去六个月	-24.84%	2.52%	-13.17%	1.86%	-11.67%	0.66%
过去一年	-40.67%	3.10%	-16.15%	2.15%	-24.52%	0.95%
过去三年	2.75%	2.26%	70.04%	1.64%	-67.29%	0.62%
自基金合同生效起至今	-6.50%	2.04%	69.17%	1.59%	-75.67%	0.45%

注：根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自2014年1月24日起，由“中证500沪市指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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、根据中国证监会 2014 年 1 月 24 日下发的《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]51 号），大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为大成健康产业股票型证券投资基金，修改基金合同中的基金名称、基金类别、基金的投资目标、投资范围、投资理念和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款。修订后的《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 1 月 24 日起正式生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自 2014 年 1 月 24 日（基金合同生效日）起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

3、根据《大成健康产业股票型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 1 月 24 日起，由“中证 500 沪市指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。



## § 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		
杨挺先生	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 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》、《大成健康产业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，大成健康产业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

首先一季度 A 股市场先是发生了罕见的快速下跌，然后在震荡中小幅回升，一季度中，上证综指下跌 15.12%、深证成指下跌 17.45%、中小板指下跌 18.22%、创业板指下跌 17.53%。进入二季度后，市场整体进入窄幅震荡的格局中，二季度中上证综指下跌 2.47%、深证成指上涨 0.33%、中小板指下跌 0.78%、创业板指下跌 0.47%，但是从主题来看，以新能源汽车和电子为代表的主题投资明显开始活跃。

其次，从经济层面来看二季度充满了各种信息冲击。首先是“两会”上监管层表示 16 年经济

增速不会不达目标，暗示“稳增长”将是政策要点，而 5 月初“权威人士”讲话中传导政策导向重回“调结构”的信号。16 年二季度地产销售增速开始回落；受销售影响，二季度的全国地产新开工增速也拐头向下；16 年二季度一线城市价格同比回落，重点城市销售端活跃度的降温，可能降低开放商的开工意愿。从高频跟踪的中观行业数据来看，钢铁、化工价格达到阶段性高点并开始回落，水泥价格也开始进入下行周期。在经济复苏难以期望的前提下，市场对于新能源汽车、OLED 等主题性机会关注度大幅度提升，同时，对于业绩明显回暖的家电、白酒等行业也增加了较大关注度。

最后，我们从组合操作层面回顾一下本报告期内组合的调整和我们配置思路的变化。今年年初经历熔断的暴跌后市场再次体现出恐慌情绪，国外政治经济环境的不稳定继续加剧了股市的不确定性，一月的两个星期产生了今年以来的大部分跌幅，由于年初仓位并不低，因此我们也并没有能够回避掉这部分损失，使得一季度末我们的组合表现并不理想。我们在一季度末做的判断是，市场从点位来看已经跌倒了比较低的位置，继续大幅下挫的风险已经释放比较多，但是市场情绪较弱，投资者信心明显不足。从宏观经济来看，经济虽然有企稳迹象，但是复苏却还为时尚早，无法推动指数大幅上升。从行业比较来看，部分传统行业已经下跌到价值区域，市场关注焦点开始聚集在业绩确定回暖或未来景气度持续高涨的行业。

在这样的情况下，我们做出了组合配置的调整，在一季度末以消费品、维生素、家用电器为主要配置的基础上增加了环保、新能源汽车、电子的持仓比重，降低了传统消费品和维生素的配置，重点配置了景气度上升的行业，组合风格更加激进，仓位在二季度一直维持在较高的水平上。二季度末，我们组合再次做出一定调整，降低了部分新能源汽车配置比重，增加了部分机械类标的的配置，兑现了白酒的收益以后，增加了医药和环保标的的配置。

#### 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 0.935 元。本报告期内基金份额净值增长率为 -24.84%，同期业绩比较基准收益率 -13.17%，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

从宏观情况来看，市场难以启动大级别行情。目前的经济情况整体处于“存量经济”。“存量经济”模式下，宏观数据呈现窄幅波动的特征。数据的向上和向下都是短期行为，很难形成中长期大趋势。16 年二季度，固定资产投资增速下滑较快，地产销售和新开工增速均回落，显示出投资需求的疲软。中游钢铁、水泥、化工等多个行业价格涨跌不一，显示出生产端的不温不火。在“存量经济”下真正能改变投资者中长期预期的因素是改革转型、流动性和汇率，但现在这三者

都没有看到积极的信号，因此对市场整体仍维持谨慎的观点。

从政策层面来看，“稳增长”和“调结构”开始出现矛盾：若“去产能”动真格，将影响地方经济增长；若减税力度加大，将影响财政收入，进而影响“稳增长”的财政支出。我们判断下半年最可能出现的情景是“稳增长”和“调结构”势均力敌，在这样的政策影响下，我们预计市场的风险偏好在较低的中枢水平上下波动。

#### 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的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金已按法律法规相关规定向中国证监会报告清盘解决方案，本基金管理人后续将根据法规规定对该事项的最新进展进行信息披露。

### § 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”）在对大成健康产业混合型证券投资基金（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：大成健康产业混合型证券投资基金

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	4,731,135.62	2,891,279.65

结算备付金		211,633.04	568,077.57
存出保证金		41,963.29	69,376.57
交易性金融资产	6.4.3.2	32,202,899.77	42,227,368.00
其中：股票投资		32,202,899.77	42,227,368.00
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		1,109,398.33	1,442,476.32
应收利息	6.4.3.5	758.71	1,026.77
应收股利		-	-
应收申购款		28,348.66	19,309.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		38,326,137.42	47,218,914.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		927,562.86	-
应付赎回款		229,410.52	63,089.68
应付管理人报酬		45,362.42	62,059.30
应付托管费		7,560.40	10,343.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	172,041.80	240,960.79
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	90,335.65	80,237.76
负债合计		1,472,273.65	456,690.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	39,411,617.93	37,604,250.04
未分配利润	6.4.3.10	-2,557,754.16	9,157,973.78
所有者权益合计		36,853,863.77	46,762,223.82
负债和所有者权益总计		38,326,137.42	47,218,914.57

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.935 元，基金份额总额 39,411,617.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-10,461,484.78	21,915,203.96
1. 利息收入		22,196.35	24,379.55
其中：存款利息收入	6.4.3.11	22,196.35	24,379.55
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）		-6,115,527.74	20,462,797.07
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-6,233,297.76	20,341,461.22
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	117,770.02	121,335.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-4,386,976.66	1,238,194.37
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	18,823.27	189,832.97
<b>减：二、费用</b>		916,201.04	1,195,968.23
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	275,917.27	394,508.93
2. 托管费	6.4.6.2.2	45,986.20	65,751.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	495,809.10	632,375.32
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	98,488.47	103,332.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,377,685.82	20,719,235.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,377,685.82	20,719,235.73

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成健康产业混合型证券投资基金

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)	37,604,250.04	9,157,973.78	46,762,223.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,377,685.82	-11,377,685.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,807,367.89	-338,042.12	1,469,325.77
其中：1. 基金申购款	18,527,313.61	-1,602,738.09	16,924,575.52
2. 基金赎回款	-16,719,945.72	1,264,695.97	-15,455,249.75
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)	39,411,617.93	-2,557,754.16	36,853,863.77
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)	36,061,686.85	-688,607.12	35,373,079.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,719,235.73	20,719,235.73
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)	-257,934.51	599,532.93	341,598.42
其中：1. 基金申购款	111,682,034.12	48,077,407.09	159,759,441.21
2. 基金赎回款	-111,939,968.63	-47,477,874.16	-159,417,842.79
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)	35,803,752.34	20,630,161.54	56,433,913.88
-----------------	---------------	---------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本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

#### 6.4.2.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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

#### 6.4.2.2 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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

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

#### 6.4.2.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发

行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

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

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 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	4,731,135.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,731,135.62

##### 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	29,598,010.06	32,202,899.77	2,604,889.71
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	29,598,010.06	32,202,899.77	2,604,889.71
----	---------------	---------------	--------------

#### 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

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	656.00
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	85.79
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	16.92
合计	758.71

#### 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	172,041.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	172,041.80

#### 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	828.05
预提费用	89,507.60
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	90,335.65

#### 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	37,604,250.04	37,604,250.04
本期申购	18,527,313.61	18,527,313.61
本期赎回(以“-”号填列)	-16,719,945.72	-16,719,945.72
- 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	39,411,617.93	39,411,617.93

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 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	6,045,680.99	3,112,292.79	9,157,973.78
本期利润	-6,990,709.16	-4,386,976.66	-11,377,685.82
本期基金份额交易产生的变动数	70,705.20	-408,747.32	-338,042.12
其中：基金申购款	-251,656.63	-1,351,081.46	-1,602,738.09
基金赎回款	322,361.83	942,334.14	1,264,695.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-874,322.97	-1,683,431.19	-2,557,754.16

#### 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
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	2,329.21

其他	440.26
合计	22,196.35

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	164,965,263.50
减：卖出股票成本总额	171,198,561.26
买卖股票差价收入	-6,233,297.76

#### 6.4.3.13 债券投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本期及上年度可比期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

#### 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	117,770.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	117,770.02

#### 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	-4,386,976.66
——股票投资	-4,386,976.66
——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	-4,386,976.66

## 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	18,039.08
转换费收入	784.19
基金转换费收入	-
合计	18,823.27

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 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	495,809.10
银行间市场交易费用	-
合计	495,809.10

## 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	14,918.54
信息披露费	74,589.06
银行划款手续费	2,980.87
中债登债券托管帐户维护费	6,000.00
银行费用	-
债券帐户维护费	-
持有人大会费用	-
其他	-
合计	98,488.47

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大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、注册登记机构、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:以下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	49,671,762.19	15.03%	-	0.00%

###### 6.4.6.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。



## 6.4.6.1.4 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	45,267.88	15.01%	-	0.00%
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	275,917.27
其中：支付销售机构的客户维护费	82,690.03	138,698.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日相应顺延。

**6.4.6.2 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	45,986.20	65,751.53

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日相应顺延。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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	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
基金合同生效日（2012年8月28日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,024,120.60	5,024,120.60
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	5,024,120.60	5,024,120.60
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.7500%	14.0300%

注：基金管理人申购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

**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**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

## 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
中国银行股份有限公司	4,731,135.62	19,426.88	5,046,267.36	21,513.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

## 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

## 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

## 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
002127	南极电商	2016年5月 16日	重大事项 停牌	10.06	-	-	202,200	1,769,264.66	2,034,132.00	-
002355	兴民智通	2016年5月 12日	重大事项 停牌	21.09	-	-	80,713	1,425,687.95	1,702,237.17	-
002686	亿利达	2016年4月 20日	重大事项 停牌	13.36	2016年7 月14日	14.89	54,800	758,451.00	732,128.00	-
600497	驰宏锌锗	2016年6月 13日	重大事项 停牌	9.97	2016年7 月11日	10.97	72,500	733,171.00	722,825.00	-
600576	万家文化	2016年4月 11日	重大事项 停牌	22.35	-	-	11,700	255,173.00	261,495.00	-

### 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

本基金本期末未持有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

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，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、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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；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。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：未持有信用类债券）。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有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

利率风险是指基金的财务状况和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。

本基金持有的金融资产大部分不计息，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的影响。本基金持有的生息资产主要为银行存款等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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	4,731,135.62	-	-	-	4,731,135.62
结算备付金	211,633.04	-	-	-	211,633.04
存出保证金	41,963.29	-	-	-	41,963.29
交易性金融资产	-	-	-	32,202,899.77	32,202,899.77
应收证券清算款	-	-	-	1,109,398.33	1,109,398.33
应收利息	-	-	-	758.71	758.71
应收申购款	-	-	-	28,348.66	28,348.66
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,984,731.95	-	-	33,341,405.47	38,326,137.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	927,562.86	927,562.86
应付赎回款	-	-	-	229,410.52	229,410.52
应付管理人报酬	-	-	-	45,362.42	45,362.42
应付托管费	-	-	-	7,560.40	7,560.40
应付交易费用	-	-	-	172,041.80	172,041.80
其他负债	-	-	-	90,335.65	90,335.65
负债总计	-	-	-	1,472,273.65	1,472,273.65
利率敏感度缺口	4,984,731.95	-	-	31,869,131.82	36,853,863.77
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	2,891,279.65	-	-	-	2,891,279.65
结算备付金	568,077.57	-	-	-	568,077.57
存出保证金	69,376.57	-	-	-	69,376.57
交易性金融资产	-	-	-	42,227,368.00	42,227,368.00
应收证券清算款	-	-	-	1,442,476.32	1,442,476.32
应收利息	-	-	-	1,026.77	1,026.77

应收申购款	-	-	-	19,309.69	19,309.69
资产总计	3,528,733.79	-	-	43,690,180.78	47,218,914.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	63,089.68	63,089.68
应付管理人报酬	-	-	-	62,059.30	62,059.30
应付托管费	-	-	-	10,343.22	10,343.22
应付交易费用	-	-	-	240,960.79	240,960.79
其他负债	-	-	-	80,237.76	80,237.76
负债总计	-	-	-	456,690.75	456,690.75
利率敏感度缺口	3,528,733.79	-	-	43,233,490.03	46,762,223.82

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末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。

#### 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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，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	32,202,899.77	87.38	42,227,368.00	90.30
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	32,202,899.77	87.38	42,227,368.00	90.30

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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%	2,440,000.00	3,272,473.71
	业绩比较基准下降5%	-2,440,000.00	-3,272,473.71

注：本基金的业绩比较基准为申万医药生物行业指数×80%+中证综合债券指数×20%。

#### 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	32,202,899.77	84.02
	其中：股票	32,202,899.77	84.02
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	4,942,768.66	12.90
7	其他各项资产	1,180,468.99	3.08
8	合计	38,326,137.42	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	894,852.00	2.43
B	采矿业	722,825.00	1.96
C	制造业	22,999,327.66	62.41
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	1,637,819.28	4.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,177,125.83	3.19
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	1,034,520.00	2.81
L	租赁和商务服务业	2,034,132.00	5.52
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	1,702,298.00	4.62
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	32,202,899.77	87.38

### 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	300499	高澜股份	20,507	2,127,806.32	5.77
2	002127	南极电商	202,200	2,034,132.00	5.52
3	603788	宁波高发	39,800	1,871,794.00	5.08
4	002001	新和成	86,900	1,836,197.00	4.98
5	300072	三聚环保	63,417	1,752,845.88	4.76
6	300015	爱尔眼科	46,600	1,702,298.00	4.62

7	002355	兴民智通	80,713	1,702,237.17	4.62
8	002422	科伦药业	109,000	1,679,690.00	4.56
9	002167	东方锆业	140,000	1,533,000.00	4.16
10	000650	仁和药业	183,800	1,499,808.00	4.07
11	002007	华兰生物	47,700	1,497,780.00	4.06
12	002675	东诚药业	30,659	1,426,563.27	3.87
13	600386	北巴传媒	73,758	1,376,324.28	3.73
14	300331	苏大维格	47,200	1,345,672.00	3.65
15	600110	诺德股份	126,926	1,248,951.84	3.39
16	002245	澳洋顺昌	92,179	1,177,125.83	3.19
17	603818	曲美家居	72,500	1,160,000.00	3.15
18	000711	京蓝科技	46,600	1,034,520.00	2.81
19	600257	大湖股份	80,400	894,852.00	2.43
20	300014	亿纬锂能	19,000	820,610.00	2.23
21	002686	亿利达	54,800	732,128.00	1.99
22	600497	驰宏锌锗	72,500	722,825.00	1.96
23	300153	科泰电源	14,182	382,772.18	1.04
24	300136	信维通信	18,200	381,472.00	1.04
25	600576	万家文化	11,700	261,495.00	0.71

#### 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	002235	安妮股份	4,092,037.00	8.75
2	002422	科伦药业	3,833,721.49	8.20
3	002117	东港股份	3,712,496.78	7.94
4	600136	当代明诚	3,544,350.01	7.58
5	600386	北巴传媒	3,014,148.00	6.45
6	002007	华兰生物	2,962,854.80	6.34
7	002597	金禾实业	2,727,974.37	5.83
8	300401	花园生物	2,537,682.66	5.43
9	300230	永利股份	2,437,772.00	5.21
10	600110	诺德股份	2,168,422.00	4.64
11	600303	曙光股份	2,166,184.02	4.63
12	002584	西陇科学	2,078,728.50	4.45

13	300499	高澜股份	1,889,857.00	4.04
14	000596	古井贡酒	1,868,173.72	4.00
15	000892	星美联合	1,858,252.90	3.97
16	002001	新和成	1,850,619.02	3.96
17	002234	民和股份	1,849,619.15	3.96
18	002127	南极电商	1,769,264.66	3.78
19	002381	双箭股份	1,767,989.00	3.78
20	002355	兴民智通	1,708,827.00	3.65
21	002626	金达威	1,697,631.00	3.63
22	300015	爱尔眼科	1,693,972.80	3.62
23	600990	四创电子	1,668,060.00	3.57
24	600257	大湖股份	1,664,391.35	3.56
25	600161	天坛生物	1,651,862.27	3.53
26	300198	纳川股份	1,624,756.00	3.47
27	002777	久远银海	1,552,791.00	3.32
28	600048	保利地产	1,546,081.00	3.31
29	002191	劲嘉股份	1,537,409.00	3.29
30	002169	智光电气	1,512,420.17	3.23
31	002294	信立泰	1,511,175.00	3.23
32	603788	宁波高发	1,495,072.76	3.20
33	600584	长电科技	1,493,227.00	3.19
34	002050	三花股份	1,490,656.50	3.19
35	300072	三聚环保	1,489,475.00	3.19
36	601607	上海医药	1,477,568.00	3.16
37	002245	澳洋顺昌	1,463,180.00	3.13
38	600518	康美药业	1,459,902.00	3.12
39	000650	仁和药业	1,456,154.50	3.11
40	002167	东方锆业	1,455,766.00	3.11
41	600056	中国医药	1,441,865.28	3.08
42	002675	东诚药业	1,431,446.20	3.06
43	002411	必康股份	1,420,809.58	3.04
44	300241	瑞丰光电	1,418,463.00	3.03
45	601388	怡球资源	1,391,900.00	2.98
46	600276	恒瑞医药	1,380,578.00	2.95
47	002674	兴业科技	1,374,793.00	2.94
48	002458	益生股份	1,353,222.00	2.89

49	600338	西藏珠峰	1,319,590.00	2.82
50	603818	曲美家居	1,312,085.00	2.81
51	600322	天房发展	1,296,585.00	2.77
52	300331	苏大维格	1,287,148.00	2.75
53	002230	科大讯飞	1,267,916.00	2.71
54	300389	艾比森	1,267,508.63	2.71
55	000531	穗恒运 A	1,231,344.00	2.63
56	002601	佰利联	1,190,064.01	2.54
57	300422	博世科	1,161,436.76	2.48
58	600259	广晟有色	1,158,797.00	2.48
59	603898	好莱客	1,148,989.02	2.46
60	600880	博瑞传播	1,143,678.00	2.45
61	600198	大唐电信	1,140,923.41	2.44
62	300136	信维通信	1,140,836.00	2.44
63	002264	新华都	1,128,892.92	2.41
64	002172	澳洋科技	1,123,980.00	2.40
65	300014	亿纬锂能	1,117,636.40	2.39
66	300098	高新兴	1,108,143.00	2.37
67	000810	创维数字	1,100,418.00	2.35
68	600458	时代新材	1,097,902.00	2.35
69	300364	中文在线	1,096,999.00	2.35
70	000722	湖南发展	1,083,921.95	2.32
71	600211	西藏药业	1,066,194.00	2.28
72	000926	福星股份	1,027,414.00	2.20
73	603968	醋化股份	1,012,125.00	2.16
74	600589	广东榕泰	987,153.00	2.11
75	002425	凯撒股份	983,348.00	2.10
76	300197	铁汉生态	973,017.00	2.08
77	600628	新世界	950,503.89	2.03
78	000698	沈阳化工	948,453.00	2.03
79	600273	嘉化能源	946,249.00	2.02
80	600851	海欣股份	942,381.00	2.02
81	000711	京蓝科技	936,911.84	2.00

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

## 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	002117	东港股份	3,641,547.57	7.79
2	002235	安妮股份	3,591,391.50	7.68
3	002019	亿帆鑫富	3,573,978.08	7.64
4	002355	兴民智通	3,388,293.46	7.25
5	600136	当代明诚	3,260,655.54	6.97
6	002597	金禾实业	3,240,540.00	6.93
7	000078	海王生物	2,856,358.20	6.11
8	300401	花园生物	2,844,285.10	6.08
9	300078	思创医惠	2,774,661.12	5.93
10	600682	南京新百	2,574,964.00	5.51
11	000952	广济药业	2,362,680.17	5.05
12	600584	长电科技	2,324,910.05	4.97
13	300230	永利股份	2,310,915.42	4.94
14	002584	西陇科学	2,229,825.46	4.77
15	002422	科伦药业	2,144,288.61	4.59
16	002234	民和股份	2,094,011.40	4.48
17	600386	北巴传媒	1,977,067.38	4.23
18	000596	古井贡酒	1,961,928.14	4.20
19	002381	双箭股份	1,830,188.00	3.91
20	002050	三花股份	1,769,542.00	3.78
21	600303	曙光股份	1,691,460.00	3.62
22	002626	金达威	1,691,266.07	3.62
23	000926	福星股份	1,655,625.55	3.54
24	000892	星美联合	1,651,933.09	3.53
25	002007	华兰生物	1,615,028.21	3.45
26	600161	天坛生物	1,581,472.40	3.38
27	002601	佰利联	1,577,782.00	3.37
28	002294	信立泰	1,571,848.90	3.36
29	000516	国际医学	1,557,765.00	3.33
30	603883	老百姓	1,556,028.00	3.33
31	600338	西藏珠峰	1,512,079.46	3.23
32	000810	创维数字	1,493,274.54	3.19
33	600990	四创电子	1,488,875.66	3.18
34	002421	达实智能	1,486,412.59	3.18

35	600079	人福医药	1,479,343.76	3.16
36	600056	中国医药	1,477,467.00	3.16
37	601607	上海医药	1,460,323.00	3.12
38	002777	久远银海	1,440,197.00	3.08
39	002730	电光科技	1,433,555.67	3.07
40	002517	恺英网络	1,422,676.86	3.04
41	600518	康美药业	1,421,265.94	3.04
42	002411	必康股份	1,419,089.00	3.03
43	600276	恒瑞医药	1,418,238.00	3.03
44	600048	保利地产	1,414,890.51	3.03
45	002169	智光电气	1,399,391.00	2.99
46	300241	瑞丰光电	1,389,841.00	2.97
47	002264	新华都	1,370,205.00	2.93
48	002674	兴业科技	1,341,070.00	2.87
49	600198	大唐电信	1,338,745.00	2.86
50	000531	穗恒运 A	1,325,550.00	2.83
51	002191	劲嘉股份	1,293,600.00	2.77
52	002458	益生股份	1,283,999.00	2.75
53	600259	广晟有色	1,260,875.00	2.70
54	002230	科大讯飞	1,246,175.00	2.66
55	002172	澳洋科技	1,239,477.00	2.65
56	300109	新开源	1,239,381.00	2.65
57	600217	秦岭水泥	1,203,524.00	2.57
58	300198	纳川股份	1,201,449.85	2.57
59	600322	天房发展	1,143,908.00	2.45
60	600458	时代新材	1,141,768.00	2.44
61	002425	凯撒股份	1,136,944.00	2.43
62	000566	海南海药	1,136,610.00	2.43
63	603898	好莱客	1,136,413.00	2.43
64	300098	高新兴	1,134,184.00	2.43
65	600110	诺德股份	1,110,607.72	2.38
66	600880	博瑞传播	1,106,647.99	2.37
67	300389	艾比森	1,083,724.92	2.32
68	002467	二六三	1,045,041.00	2.23
69	600211	西藏药业	1,032,587.00	2.21
70	600122	宏图高科	1,028,853.00	2.20
71	300364	中文在线	980,195.36	2.10
72	002434	万里扬	969,615.00	2.07

73	300422	博世科	962,917.00	2.06
74	601388	怡球资源	947,899.33	2.03
75	002196	方正电机	946,942.00	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。

#### 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	165,561,069.69
卖出股票收入（成交）总额	164,965,263.50

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

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

注：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 本基金投资的前十名证券之一东方锆业，2016 年 1 月 23 日因“违规使用募集资金”收到中国证监会《行政处罚决定书》。本基金认为，对东方锆业的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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	41,963.29
2	应收证券清算款	1,109,398.33
3	应收股利	-
4	应收利息	758.71
5	应收申购款	28,348.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,180,468.99

**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	002127	南极电商	2,034,132.00	5.52	重大事项停牌
2	002355	兴民智通	1,702,237.17	4.62	重大事项停牌

**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
3,430	11,490.27	5,024,120.60	12.75%	34,387,497.33	87.25%

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	9,915.53	0.0252%

### 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（2012年8月28日）基金份额总额	322,007,363.05
本报告期期初基金份额总额	37,604,250.04
本报告期基金总申购份额	18,527,313.61
减：本报告期基金总赎回份额	16,719,945.72
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	39,411,617.93

## § 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安永华明会计师事务所（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	
财富证券	1	55,059,395.86	16.66%	50,177.13	16.64%	-
光大证券	2	49,671,762.19	15.03%	45,267.88	15.01%	-
国海证券	1	39,511,354.86	11.95%	36,006.82	11.94%	-
江海证券	1	35,680,471.80	10.80%	32,517.60	10.78%	-
广州证券	1	29,166,017.13	8.82%	26,576.80	8.81%	-
长江证券	1	25,787,370.32	7.80%	23,499.65	7.79%	-

渤海证券	2	20,308,032.77	6.14%	18,506.99	6.14%	-
中投证券	3	17,737,057.81	5.37%	16,469.61	5.46%	-
国都证券	1	14,548,295.93	4.40%	13,259.96	4.40%	-
方正证券	1	12,998,428.61	3.93%	11,845.60	3.93%	-
万联证券	1	10,542,245.81	3.19%	9,606.80	3.19%	-
华宝证券	1	7,307,669.85	2.21%	6,659.96	2.21%	-
华福证券	1	6,431,176.00	1.95%	5,859.15	1.94%	-
民生证券	1	3,002,110.23	0.91%	2,735.82	0.91%	-
申银万国	1	2,774,944.02	0.84%	2,528.84	0.84%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华鑫证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
民族证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	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。

本报告期内本基金新增席位：恒泰证券、方正证券、平安证券。本报告期内本基金退租席位：无。

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	大成健康产业股票型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
2	大成健康产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 11 日
3	大成健康产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 11 日
4	大成健康产业混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日
5	大成健康产业混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 3 月 26 日

6	大成健康产业混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公 司网站	2016 年 4 月 22 日
7	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
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 19 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 6 月 3 日
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	2016 年 6 月 16 日
11	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
12	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 年 1 月 6 日
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 年 1 月 8 日
14	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
15	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
16	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
17	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

18	大成基金管理有限公司关于增加北京 惠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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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年4月27日
26	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
27	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
28	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

29	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
30	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
31	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
32	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
33	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证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《关于大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3、《大成健康产业混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《大成健康产业混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 6、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