

大成策略回报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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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.....	10
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.....	31
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.....	32
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37

§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	38
§9 开放式基金份额变动	39
§10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成策略回报混合型证券投资基金
基金简称	大成策略回报混合
基金主代码	090007
交易代码	090007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 11 月 26 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	367,819,644.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。
投资策略	本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性地减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中债综合指数
风险收益特征	本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种，其长期平均的预期收益和风险低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	张建春
	联系电话	0755-83183388	010-63639180
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、 甲 25 号中国光大中心
邮政编码	518040	100033
法定代表人	刘卓	唐双宁

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	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	5,487,495.92
本期利润	-14,846,274.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0438
本期加权平均净值利润率	-3.78%
本期基金份额净值增长率	-2.26%
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	76,708,647.03
期末可供分配基金份额利润	0.2085
期末基金资产净值	444,528,291.54
期末基金份额净值	1.209
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	252.97%

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。

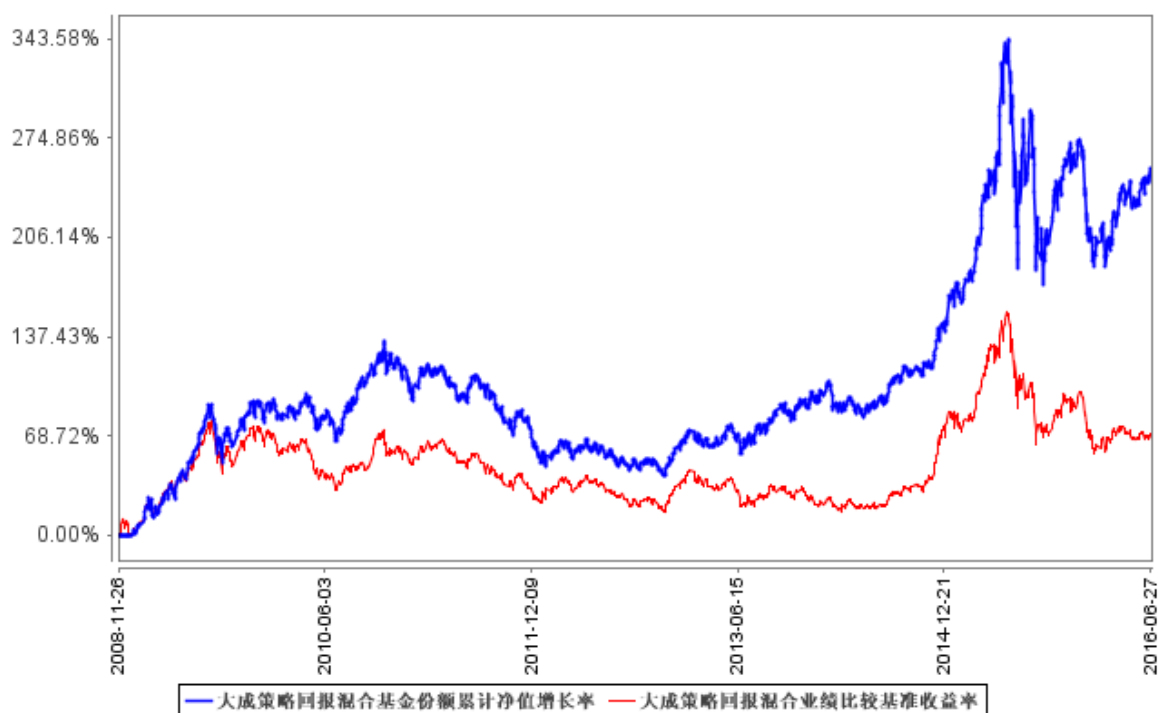
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	4.49%	1.24%	-0.24%	0.78%	4.73%	0.46%
过去三个月	9.41%	1.23%	-1.47%	0.81%	10.88%	0.42%
过去六个月	-2.26%	1.90%	-12.01%	1.47%	9.75%	0.43%
过去一年	-3.42%	2.64%	-22.62%	1.84%	19.20%	0.80%
过去三年	119.71%	1.93%	40.50%	1.47%	79.21%	0.46%
自基金合同生效起至今	252.97%	1.61%	70.52%	1.36%	182.45%	0.25%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金已完成建仓。建仓期结束时，本基金的各项资产配置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		
徐彦先生	本基金基金经理	2012 年 10 月 31 日	-	10 年	<p>管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部，2007 年加入大成基金研究部，曾任中游制造行业研究主管，2011 年 7 月 29 日至 2012 年 10 月 27 日曾任景宏证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012 年 10 月 31 日至 2015 年 7 月 21 日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2014 年 4 月 25 日至 2015 年 7 月 21 日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 22 日起任大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 3 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。</p> <p>2015 年 9 月 15 日起任景阳领先混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>

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》、《大成策略回报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，大成策略回报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

年初至二月份，因为宏观层面的担心以及新兴产业估值过高，市场有所调整。在报告期内，本基金减持了行业发生变化或者是预期过高的个股；在一季度增持了跟新商业模式相关的个股，在二季度增持了估值更低、但长期竞争力明显的传统行业个股。

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 1.209 元。本报告期内基金份额净值增长率为-2.26%，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

在宏观层面，不要低估系统性风险，尤其是当大家渐渐忘却这种风险时。当全球的人民和政治家习惯了长期经济增长，并且认为要靠刺激经济解决各种问题时，我们得明白经济增长依赖于某些不为人控制的更长期变量，而不是货币、民意、政治或者口号。问题没有解决，中国只是更稳定，但稳定也有代价。

我不知道全球主要经济体长期负利率下，资金短期内会追逐什么，但主要问题没有解决时涨多了不要太乐观。在市场波动中，以合适的价格买入优秀的公司将是本基金的长期理念。

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。本报告期内本基金已分配利润 130,275,984.54 元（每十份基金份额分红 4.964 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遵规守信情况声明

2016 年上半年，中国光大银行股份有限公司在大成策略回报混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对大成策略回报混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016 年上半年，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——大成基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、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方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的“大成策略回报混合型证券投资基金 2016 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§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：大成策略回报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	114,163,840.74	108,988,767.90
结算备付金		656,651.34	92,145.11
存出保证金		162,401.95	180,336.19
交易性金融资产	6.4.3.2	330,807,430.65	368,905,858.39
其中：股票投资		328,936,701.75	368,905,858.39
基金投资		-	-
债券投资		1,870,728.90	-
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	23,344.78	22,764.45
应收股利		-	-
应收申购款		799,882.60	115,395.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		446,613,552.06	478,305,267.73
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		1,208.39	2,374,136.34
应付赎回款		649,078.50	1,336,926.24
应付管理人报酬		525,858.46	614,445.21
应付托管费		87,643.07	102,407.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	317,723.69	90,767.27
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	503,748.41	424,010.28
负债合计		2,085,260.52	4,942,692.85
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	367,819,644.51	259,048,764.66
未分配利润	6.4.3.10	76,708,647.03	214,313,810.22
所有者权益合计		444,528,291.54	473,362,574.88
负债和所有者权益总计		446,613,552.06	478,305,267.73

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.209 元，基金份额总额 367,819,644.51 份。

6.2 利润表

会计主体：大成策略回报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
一、收入		-10,366,023.49	247,333,031.19
1.利息收入		348,667.45	791,556.87
其中：存款利息收入	6.4.3.11	347,546.67	161,842.90
债券利息收入		1,120.78	629,713.97
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）		9,531,500.34	232,802,119.66
其中：股票投资收益	6.4.3.12	8,031,818.97	229,291,041.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	126,750.00
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	1,499,681.37	3,384,328.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-20,333,770.10	13,492,405.90
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	87,578.82	246,948.76
减：二、费用		4,480,250.69	7,132,210.25
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	2,929,010.87	4,638,967.58
2. 托管费	6.4.6.2.2	488,168.49	773,161.28
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	861,910.50	1,513,671.22
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	201,160.83	206,410.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,846,274.18	240,200,820.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,846,274.18	240,200,820.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成策略回报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）	259,048,764.66	214,313,810.22	473,362,574.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,846,274.18	-14,846,274.18
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）	108,770,879.85	7,517,095.53	116,287,975.38
其中：1.基金申购款	183,998,845.91	15,323,679.75	199,322,525.66

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	114,163,840.74
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	114,163,840.74

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	296,686,620.11	328,936,701.75	32,250,081.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,531,000.00	1,870,728.90
	银行间市场	-	-
	合计	1,531,000.00	1,870,728.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	298,217,620.11	330,807,430.65	32,589,810.54

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	21,855.40
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	295.50
应收债券利息	1,120.78
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	73.10
合计	23,344.78

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	317,723.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	317,723.69

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	2,247.09
预提费用	251,501.32
其他	-
合计	503,748.41

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	259,048,764.66	259,048,764.66
本期申购	183,998,845.91	183,998,845.91
本期赎回(以“-”号填列)	-75,227,966.06	-75,227,966.06
- 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	367,819,644.51	367,819,644.51

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	243,123,934.43	-28,810,124.21	214,313,810.22
本期利润	5,487,495.92	-20,333,770.10	-14,846,274.18
本期基金份额交易产生的变动数	48,812,474.62	-41,295,379.09	7,517,095.53

其中：基金申购款	82,991,760.22	-67,668,080.47	15,323,679.75
基金赎回款	-34,179,285.60	26,372,701.38	-7,806,584.22
本期已分配利润	-130,275,984.54	-	-130,275,984.54
本期末	167,147,920.43	-90,439,273.40	76,708,647.03

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	343,030.42
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	3,461.50
其他	1,054.75
合计	347,546.67

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	296,305,660.21
减：卖出股票成本总额	288,273,841.24
买卖股票差价收入	8,031,818.97

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	1,499,681.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,499,681.37

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	-20,333,770.10
——股票投资	-20,673,499.00
——债券投资	339,728.90
——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	-20,333,770.10

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	86,956.08
转换费收入	622.74
其他	-
合计	87,578.82

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 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	861,910.50
银行间市场交易费用	-
合计	861,910.50

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	32,323.20
信息披露费	149,178.12
银行划款手续费	10,659.51
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
债券托管帐户维护费	-
合计	201,160.83

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、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”)	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
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)
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
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
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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方交易单元进行的交易。

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	2,929,010.87	4,638,967.58
其中：支付销售机构的客户维护费	537,248.78	903,963.62

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 × 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 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	488,168.49	773,161.28

注：支付基金托管人中国光大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。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

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

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
中国光大银行	114,163,840.74	343,030.42	42,755,675.06	156,490.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

无。

6.4.7 利润分配情况

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年1月21日	2016年1月21日	4.964	67,189,808.18	63,086,176.36	130,275,984.54	
合计	-	-	4.964	67,189,808.18	63,086,176.36	130,275,984.54	

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年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	3,287	42,665.26	42,665.26	-

			日							
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	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
002127	南极电商	2016年5月23日	临时停牌	10.06	-	-	2,682,884	22,250,260.39	26,989,813.04	-
000002	万科A	2015年12月21日	临时停牌	18.20	2016年7月4日	21.99	235	1,843.16	4,277.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	临时停牌	19.22	-	-	126	1,431.58	2,421.72	-
600146	商赢环球	2016年6月15日	临时停牌	24.42	-	-	58	1,971.07	1,416.36	-
300166	东方国信	2016年6月8日	临时停牌	28.23	-	-	30	328.05	846.90	-
002686	亿	2016	临	13.36	2016	14.89	40	235.47	534.40	-

	利达	年 4 月 20 日	时停牌		年 7 月 14 日					
300284	苏文科	2016 年 5 月 20 日	临时停牌	23.62	-	-	22	326.60	519.64	-
600759	洲际油气	2016 年 6 月 27 日	临时停牌	7.58	2016 年 7 月 11 日	8.10	11	107.44	83.38	-

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

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，建立了以由最高监控(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)、日常监察(督察长和监察稽核部)、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，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立投资风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成日常运作风险管理以及进行运作风险分析。监察稽核部由督察长分管。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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光大银行，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，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资占基金资产净值的比例为 0.42%(2015 年 12 月 31 日：无)。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末未持有短期信用类债券。

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,870,728.90	-
未评级	-	-
合计	1,870,728.90	-

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、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	114,163,840.74	-	-	-	114,163,840.74
结算备付金	656,651.34	-	-	-	656,651.34
存出保证金	162,401.95	-	-	-	162,401.95
交易性金融 资产	-	-	1,870,728.90	328,936,701.75	330,807,430.65
应收利息	-	-	-	23,344.78	23,344.78
应收申购款	646.12	-	-	799,236.48	799,882.60
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	114,983,540.15	-	1,870,728.90	329,759,283.01	446,613,552.06
负债					
应付证券清 算款	-	-	-	1,208.39	1,208.39
应付赎回款	-	-	-	649,078.50	649,078.50
应付管理人 报酬	-	-	-	525,858.46	525,858.46
应付托管费	-	-	-	87,643.07	87,643.07
应付交易费 用	-	-	-	317,723.69	317,723.69
其他负债	-	-	-	503,748.41	503,748.41
负债总计	-	-	-	2,085,260.52	2,085,260.52
利率敏感度 缺口	114,983,540.15	-	1,870,728.90	327,674,022.49	444,528,291.54
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	108,988,767.90	-	-	-	108,988,767.90
结算备付金	92,145.11	-	-	-	92,145.11
存出保证金	180,336.19	-	-	-	180,336.19
交易性金融 资产	-	-	-	368,905,858.39	368,905,858.39
应收利息	-	-	-	22,764.45	22,764.45
应收申购款	546.72	-	-	114,848.97	115,395.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	109,261,795.92	-	-	369,043,471.81	478,305,267.73
负债					

应付证券清算款	-	-	-	2,374,136.34	2,374,136.34
应付赎回款	-	-	-	1,336,926.24	1,336,926.24
应付管理人报酬	-	-	-	614,445.21	614,445.21
应付托管费	-	-	-	102,407.51	102,407.51
应付交易费用	-	-	-	90,767.27	90,767.27
其他负债	-	-	-	424,010.28	424,010.28
负债总计	-	-	-	4,942,692.85	4,942,692.85
利率敏感度缺口	109,261,795.92	-	-	-364,100,778.96	473,362,574.88

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

本基金于本报告期末持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.42% (2015 年 12 月 31 日：0.00%)，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”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。本基金的股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%；权证投资比例范围为基金资产的 0%—3%；债券投资比例范围为基金资产的 0%—35%；资产支持证券投资比例范围为基金资产的 0%—20%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不

低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	328,936,701.75	74.00	368,905,858.39	77.93
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	328,936,701.75	74.00	368,905,858.39	77.93

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）
	1. 业绩比较基准上升 5%		26,930,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%		-26,930,000.00	-28,820,000.00

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	328,936,701.75	73.65
	其中：股票	328,936,701.75	73.65
2	固定收益投资	1,870,728.90	0.42
	其中：债券	1,870,728.90	0.42
	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	114,820,492.08	25.71
7	其他各项资产	985,629.33	0.22
8	合计	446,613,552.06	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	3,537.10	0.00
B	采矿业	3,234,368.98	0.73
C	制造业	260,944,188.68	58.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,881.78	0.02
E	建筑业	404.70	0.00
F	批发和零售业	28,504,641.97	6.41
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	3,533,429.41	0.79
J	金融业	3,877.61	0.00
K	房地产业	5,472,528.88	1.23
L	租赁和商务服务业	27,001,552.64	6.07
M	科学研究和技术服务业	20,645.74	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	70.40	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	146,573.86	0.03
S	综合	-	0.00
	合计	328,936,701.75	74.00

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	600885	宏发股份	1,356,810	41,667,635.10	9.37
2	002126	银轮股份	4,645,800	40,975,956.00	9.22
3	600060	海信电器	2,086,501	36,889,337.68	8.30
4	000338	潍柴动力	4,245,820	33,159,854.20	7.46
5	600998	九州通	1,627,345	28,494,810.95	6.41
6	002127	南极电商	2,682,884	26,989,813.04	6.07
7	000059	华锦股份	1,957,330	18,203,169.00	4.09
8	002475	立讯精密	853,005	16,761,548.25	3.77
9	002138	顺络电子	913,504	16,561,827.52	3.73
10	000980	金马股份	1,209,333	13,471,969.62	3.03
11	600835	上海机电	412,849	7,922,572.31	1.78
12	002422	科伦药业	498,371	7,679,897.11	1.73
13	002434	万里扬	510,800	5,557,504.00	1.25
14	600240	华业地产	545,600	5,466,912.00	1.23
15	000581	威孚高科	252,400	5,088,384.00	1.14
16	002456	欧菲光	144,800	4,271,600.00	0.96
17	002223	鱼跃医疗	120,757	3,830,412.04	0.86
18	002006	精工科技	271,400	3,672,042.00	0.83
19	600028	中国石化	685,230	3,234,285.60	0.73
20	002588	史丹利	204,400	2,524,340.00	0.57
21	002268	卫士通	65,298	2,333,750.52	0.52
22	000903	云内动力	124,772	1,001,919.16	0.23
23	002773	康弘药业	19,500	907,725.00	0.20
24	300231	银信科技	40,700	750,508.00	0.17
25	600570	恒生电子	5,586	372,977.22	0.08

26	000333	美的集团	12,025	285,233.00	0.06
27	300291	华录百纳	6,222	146,403.66	0.03
28	002572	索菲亚	1,696	95,009.92	0.02
29	002039	黔源电力	3,686	70,881.78	0.02
30	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
31	002206	海利得	2,957	50,653.41	0.01
32	002029	七匹狼	4,395	44,609.25	0.01
33	601966	玲珑轮胎	3,287	42,665.26	0.01
34	600872	中炬高新	3,029	37,377.86	0.01
35	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
36	002038	双鹭药业	984	29,697.12	0.01
37	603456	九洲药业	1,000	25,820.00	0.01
38	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
39	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
40	300054	鼎龙股份	750	18,765.00	0.00
41	000550	江铃汽车	675	16,443.00	0.00
42	300204	舒泰神	877	16,171.88	0.00
43	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
44	300071	华谊嘉信	1,087	11,739.60	0.00
45	601965	中国汽研	1,034	9,936.74	0.00
46	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
47	000028	国药一致	100	6,510.00	0.00
48	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
49	002450	康得新	300	5,130.00	0.00
50	000002	万科A	235	4,277.00	0.00
51	601222	林洋电子	94	3,933.90	0.00
52	002714	牧原股份	70	3,537.10	0.00
53	000895	双汇发展	147	3,069.36	0.00
54	002035	华帝股份	120	2,937.60	0.00
55	600521	华海药业	117	2,845.44	0.00
56	600588	DR 用友网	144	2,819.52	0.00
57	601318	中国平安	84	2,691.36	0.00
58	600976	健民集团	100	2,685.00	0.00
59	000651	格力电器	126	2,421.72	0.00
60	000400	许继电气	150	2,316.00	0.00
61	002236	大华股份	170	2,227.00	0.00
62	300210	森远股份	100	1,788.00	0.00
63	002582	好想你	45	1,778.40	0.00
64	300011	鼎汉技术	74	1,736.78	0.00

65	002230	科大讯飞	51	1,675.35	0.00
66	300360	炬华科技	70	1,584.10	0.00
67	600146	大元股份	58	1,416.36	0.00
68	002367	康力电梯	90	1,386.00	0.00
69	002271	东方雨虹	80	1,378.40	0.00
70	300195	长荣股份	73	1,354.15	0.00
71	002285	世联行	172	1,339.88	0.00
72	600703	三安光电	63	1,258.11	0.00
73	603111	康尼机电	83	1,113.86	0.00
74	600705	中航资本	182	1,070.16	0.00
75	002366	台海核电	19	1,012.89	0.00
76	300166	东方国信	30	846.90	0.00
77	002508	老板电器	22	808.94	0.00
78	600887	伊利股份	42	700.14	0.00
79	600089	特变电工	81	690.12	0.00
80	002690	美亚光电	28	645.12	0.00
81	601933	永辉超市	154	636.02	0.00
82	000876	新希望	76	632.32	0.00
83	002686	亿利达	40	534.40	0.00
84	300284	苏交科	22	519.64	0.00
85	600527	江南高纤	65	443.30	0.00
86	000921	海信科龙	54	428.22	0.00
87	600496	精工钢构	95	404.70	0.00
88	600446	金证股份	10	359.50	0.00
89	600801	华新水泥	45	283.95	0.00
90	600880	博瑞传播	20	170.20	0.00
91	600016	民生银行	13	116.09	0.00
92	600759	洲际油气	11	83.38	0.00
93	000069	华侨城 A	11	70.40	0.00
94	300303	聚飞光电	7	66.57	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	000338	潍柴动力	34,708,549.51	7.33

2	600060	海信电器	34,496,971.08	7.29
3	002127	南极电商	26,710,879.15	5.64
4	000059	华锦股份	21,596,199.91	4.56
5	000980	金马股份	18,007,730.68	3.80
6	600885	宏发股份	12,827,130.00	2.71
7	002268	卫士通	11,656,274.48	2.46
8	600835	上海机电	11,463,068.51	2.42
9	000581	威孚高科	10,662,561.05	2.25
10	002422	科伦药业	8,219,617.14	1.74
11	002582	好想你	6,596,525.80	1.39
12	300011	鼎汉技术	6,364,896.04	1.34
13	300360	炬华科技	6,349,802.97	1.34
14	600028	中国石化	5,901,885.00	1.25
15	600240	华业资本	5,127,851.36	1.08
16	002434	万里扬	4,951,740.00	1.05
17	002126	银轮股份	4,846,597.00	1.02
18	002456	欧菲光	4,014,415.81	0.85
19	002367	康力电梯	3,782,194.00	0.80
20	600089	特变电工	3,782,192.28	0.80

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	002422	科伦药业	33,400,941.93	7.06
2	002588	史丹利	29,375,141.85	6.21
3	002138	顺络电子	27,438,123.98	5.80
4	600759	洲际油气	20,987,527.54	4.43
5	601933	永辉超市	18,034,418.03	3.81
6	000333	美的集团	16,195,430.88	3.42
7	002475	立讯精密	13,553,852.81	2.86
8	002271	东方雨虹	10,568,097.05	2.23
9	300284	苏交科	10,322,327.45	2.18
10	600885	宏发股份	9,935,778.29	2.10
11	000980	金马股份	8,748,237.46	1.85
12	002268	卫士通	8,443,412.63	1.78

13	002582	好想你	7,392,981.84	1.56
14	300011	鼎汉技术	6,948,898.64	1.47
15	300360	炬华科技	6,617,799.29	1.40
16	002126	银轮股份	6,515,017.82	1.38
17	600146	商赢环球	5,872,917.99	1.24
18	000059	华锦股份	5,663,006.06	1.20
19	000581	威孚高科	5,201,881.20	1.10
20	002127	南极电商	5,045,758.23	1.07

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	268,978,183.60
卖出股票收入（成交）总额	296,305,660.21

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	1,870,728.90	0.42
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	1,870,728.90	0.42

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

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	110034	九州转债	15,310	1,870,728.90	0.42

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

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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	162,401.95

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,344.78
5	应收申购款	799,882.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	985,629.33

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	26,989,813.04	6.07	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
21,820	16,857.00	25,444,240.74	6.92%	342,375,403.77	93.08%

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	112,250.62	0.0300%

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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	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（2008年11月26日）基金份额总额	1,058,010,199.76
本报告期期初基金份额总额	259,048,764.66
本报告期基金总申购份额	183,998,845.91
减：本报告期基金总赎回份额	75,227,966.06
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	367,819,644.51

§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	
中银国际	1	332,041,885.54	58.75%	302,590.66	58.70%	-
中金公司	1	135,602,127.27	23.99%	124,024.04	24.06%	-
招商证券	1	65,748,985.93	11.63%	59,922.98	11.63%	-
东海证券	1	16,736,337.29	2.96%	15,251.37	2.96%	-
金元证券	1	15,005,519.99	2.66%	13,675.77	2.65%	-

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。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金退出交易单元：无；

本报告期内本基金新增交易单元：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	大成策略回报混合型证券投资基金更新的招募说明书（2015 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 11 日
2	大成策略回报混合型证券投资基金更新的招募说明书（2015 年第 2 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 11 日
3	大成策略回报混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 1 月 20 日
4	大成策略回报混合型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 年 1 月 20 日
5	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 1 月 20 日
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 3 月 18 日
7	大成策略回报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
8	大成策略回报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
9	大成策略回报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
10	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 4 月 23 日
11	大成基金管理有限公司关于公司	中国证监会指定报	2016 年 5 月 19 日

	旗下部分基金估值调整的公告	刊及本公司网站	
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 1 日
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 3 日
14	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
15	大成基金管理有限公司关于增加增加江西银行股份有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2016 年 6 月 14 日
16	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 年 6 月 16 日
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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

22	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
23	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
24	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
25	大成基金管理有限公司关于增加北京蕙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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	关于大成基金管理有限公司上海	中国证监会指定报	2016 年 3 月 29 日

	理财中心业务变更的公告	刊及本公司网站	
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	大成基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定报	2016 年 6 月 22 日

	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	刊及本公司网站	
40	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策略回报混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成策略回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

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