

大成景益平稳收益混合型证券投资基金
2014 年年度报告摘要
2014 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成景益平稳收益混合
基金主代码	000695
交易代码	000695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 26 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,097,696,187.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将有采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	134,615,233.05
本期利润	371,033,808.89
加权平均基金份额本期利润	0.5046
本期基金份额净值增长率	43.50%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1459
期末基金资产净值	1,575,410,782.62
期末基金份额净值	1.435

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。

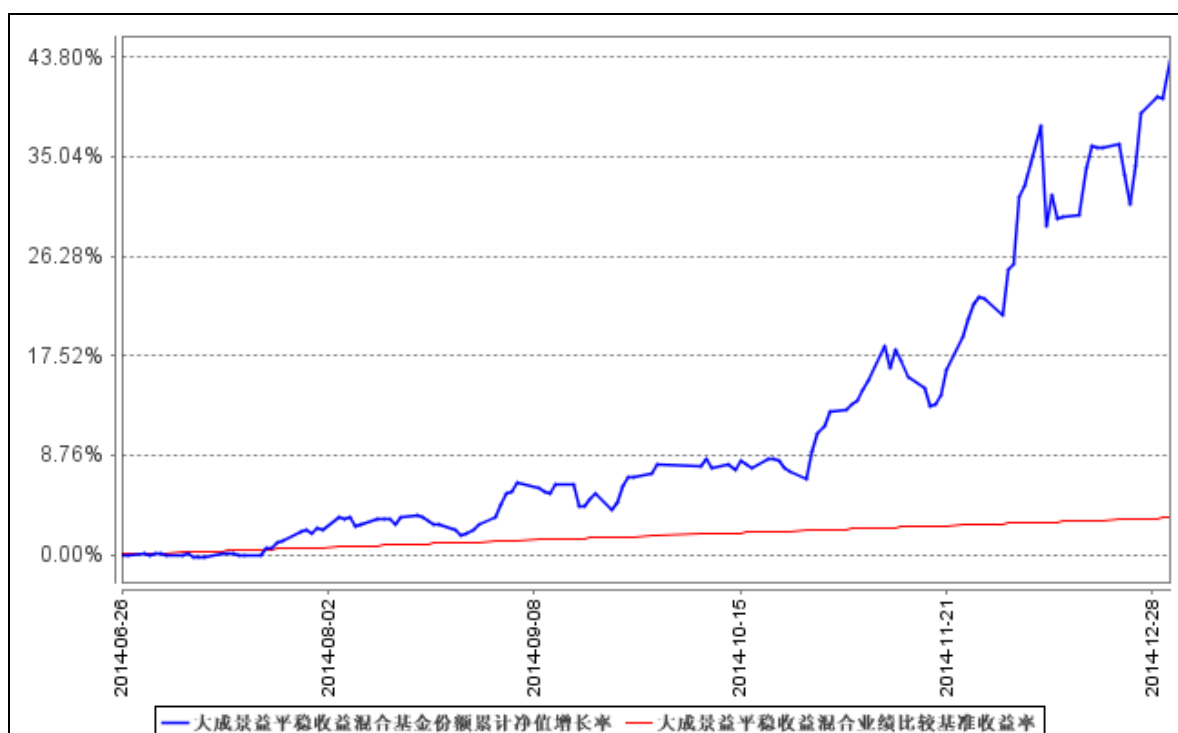
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	32.87%	1.70%	1.55%	0.02%	31.32%	1.68%
过去六个月	43.36%	1.25%	3.15%	0.02%	40.21%	1.23%
自基金合同生效起至今	43.50%	1.24%	3.24%	0.02%	40.26%	1.22%

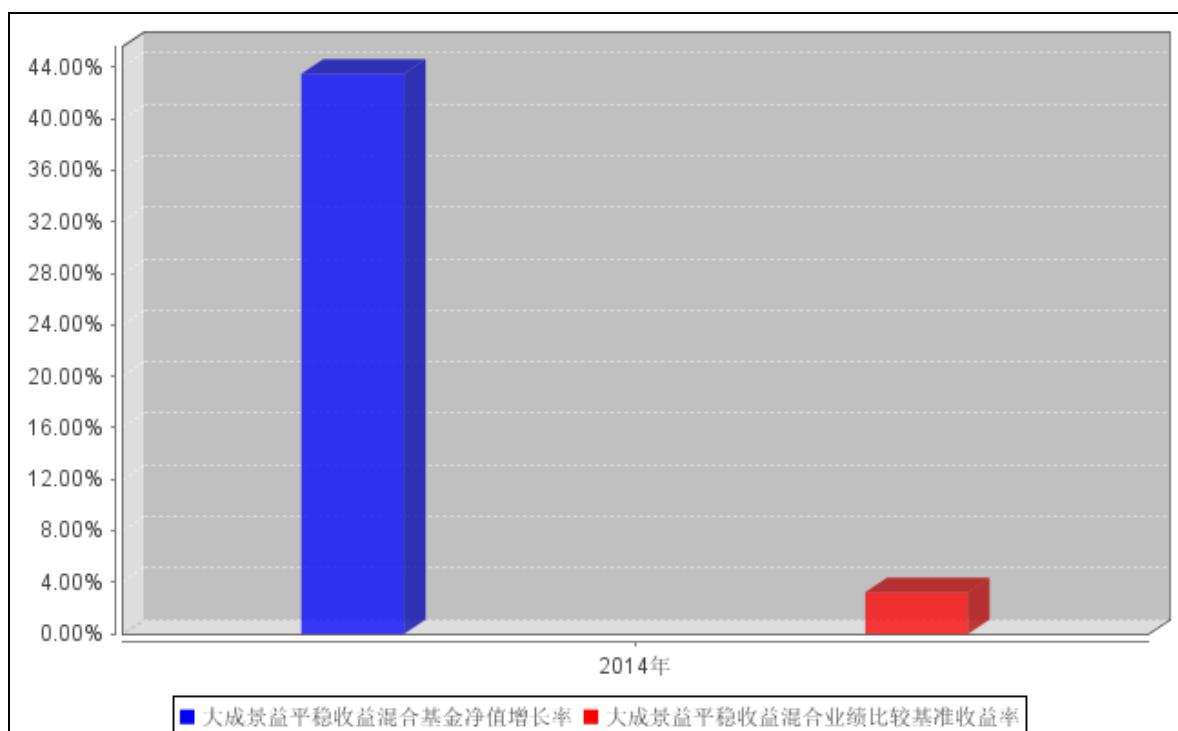
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2014 年 6 月 26 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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



注：2014 年净值增长率表现期间为 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2014 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 4 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，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 40 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、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（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、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（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和大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王磊先生	本基金基金经理	2014年6月26日	-	10年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监（主持工作）。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2013年7月17日起任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起兼任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014年12月9日起任大成景利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
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2014年6月26日	-	10年	南开大学经济学学士，2004年7月至2010年5月就职于深圳农村商业银行，任资金部投资经理；2010年5月至2012年10月就职于博时基金管理有限公司，任交易部交易员；2012年10月至2013年5月就职于银华基金管理有限公司，任固定收益部基金经理助理；2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。

					2014 年 3 月 18 日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014 年 3 月 18 日起任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014 年 6 月 23 日起任大成丰财宝货币市场基金（原大成招财宝货币市场基金）基金经理助理。2014 年 6 月 26 日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014 年 12 月 24 日起，任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015 年 3 月 21 日起担任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券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》、《大成景益平稳收益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，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各

个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 23 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年中国债券市场经历了一轮波澜壮阔的牛市。去年年初债券绝对收益率处于历史高位，之后在基本面引导和政策面呵护下，收益率一直处于下行通道，中间偶有反复，但随后市场都迎来一波更大级别的牛市行情。股市受市场风险偏好增加和估值修复影响，市场呈现牛市特征，两市成交量急剧放大，融资融券余额大幅增加。整体看，中债综合财富总指数大幅上涨 10.34%，中证转债指数上涨 56.94%，沪深 300 上涨 51.66%。

操作上，本组合根据基本面和政策面变化，积极研究不同类别资产风险收益特征，在建仓期保持一定债券比例配置，大力增配权益和转债资产，通过大类资产配置获取投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.435 元，本报告期份额净值增长率为 43.5%，同期业绩比较基准增长率为 3.24%，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 2015 年，我们对债券市场仍抱有乐观预期。在房地产周期性下行带动下，经济基本方面面临惯性下滑压力。从物价指数看，我们面临一定的通缩压力，为保持经济稳定增长，维持实际利率水平稳定，央行在 2 月份分别启动降准降息操作。但是，在调结构大环境下，央行对货币政策全面放松顾虑较多，担心产能过剩部门进一步加杠杆，所以我们看到全面降准总是姗姗来迟。我们看好今年债市表现，在经济下滑、通缩压力和外占流出影响下，央行货币政策持续放松是可以期待的。

权益和转债市场方面，在深化改革和货币政策宽松推动下，经济基本面预计会出现向好苗头。另外，一带一路、国企改革、节能环保、区域经济一体化等主题性投资机会层出不穷，股市的机会大于风险。

2015 年，本组合将保持灵活操作，提前研判宏观经济基本面变化，灵活布局，及时调整债券结构和比例，增加可转债和权益类波段操作，提高组合收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持，我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，积极进行资产配置，适时调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托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、固定收益部、风险管理部和委托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。本报告期末本基金无可供分配收益。

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

在托管大成景益平稳收益混合基金的过程中，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《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金托管协议》的约定，对大成景益平稳收益混合型证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2014 年 6 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成景益平稳收益混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法

规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的大成景益平稳收益混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金 2014 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	140,235,298.48
结算备付金	29,990,575.08
存出保证金	283,497.84
交易性金融资产	1,912,739,975.12
其中：股票投资	404,526,430.85
基金投资	-
债券投资	1,508,213,544.27
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	10,902,754.69
应收利息	19,095,153.14
应收股利	-
应收申购款	958,155.10
递延所得税资产	-
其他资产	-

资产总计	2, 114, 205, 409. 45
负债和所有者权益	本期末 2014 年 12 月 31 日
负 债:	
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	502, 699, 984. 70
应付证券清算款	32, 254, 849. 93
应付赎回款	1, 055, 062. 52
应付管理人报酬	942, 823. 75
应付托管费	294, 632. 42
应付销售服务费	-
应付交易费用	1, 314, 054. 31
应交税费	-
应付利息	72, 294. 22
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	160, 924. 98
负债合计	538, 794, 626. 83
所有者权益:	
实收基金	1, 097, 696, 187. 40
未分配利润	477, 714, 595. 22
所有者权益合计	1, 575, 410, 782. 62
负债和所有者权益总计	2, 114, 205, 409. 45

注：(1) 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.435 元，基金份额总额 1,097,696,187.40 份。

(2) 本基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日，2014 年度实际报告期间为 2014 年 6 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	383, 397, 782. 33
1. 利息收入	12, 420, 517. 50
其中：存款利息收入	381, 726. 91

债券利息收入	10,530,753.09
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,508,037.50
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	133,755,119.66
其中：股票投资收益	67,646,948.70
基金投资收益	-
债券投资收益	66,101,605.36
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	6,565.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	236,418,575.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	803,569.33
减：二、费用	12,363,973.44
1. 管理人报酬	3,398,043.75
2. 托管费	1,061,888.72
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	2,620,974.80
5. 利息支出	5,097,869.86
其中：卖出回购金融资产支出	5,097,869.86
6. 其他费用	185,196.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	371,033,808.89
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	371,033,808.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景益平稳收益混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	695,878,758.69	-	695,878,758.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	371,033,808.89	371,033,808.89

润)			
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)	401,817,428.71	106,680,786.33	508,498,215.04
其中: 1. 基金申购款	552,109,637.63	118,799,618.75	670,909,256.38
2. 基金赎回款	-150,292,208.92	-12,118,832.42	-162,411,041.34
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)	1,097,696,187.40	477,714,595.22	1,575,410,782.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

 罗登攀 肖剑 范瑛
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成景益平稳收益混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 586 号《关于核准大成景益平稳收益混合型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 695,871,452.68 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 379 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 695,878,758.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,306.01 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 30%,债券、货币市场工具等固定收益类金融工具占基金资产的

比例不低于 70%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资业绩比较基准为：3 年期银行定期存款利率(税后)+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2015 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的

市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、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
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	251,114,948.45	14.27%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
光大证券	226,455.93	14.30%	200,155.54	15.34%

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,398,043.75
其中：支付销售机构的客户维护费	96,522.43

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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,061,888.72

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

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 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						
2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31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	29,865,383.42	-	-	-	120,000,000.00	8,807.95

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	
	2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
基金合同生效日(2014 年 6 月 26 日)持有的基金份额	9,999,000.00	
期初持有的基金份额	-	
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	9,999,000.00	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9109%	

注:基金管理人大成基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托大成直销中心办理,申购费为 1,000.00 元人民币。

7.4.8.4.2 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

本报告期内本基金未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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	
	2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	140,235,298.48	253,837.32

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

110030	格力转债	2014-12-30	2015-1-13	新债未上市	100.00	100.00	49,850.00	4,985,000.00	4,985,000.00	-
--------	------	------------	-----------	-------	--------	--------	-----------	--------------	--------------	---

7.4.9.2 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
600428	中远航运	2014/12/22	重大事项	8.00	2015/01/08	8.30	2,000,000	9,842,170.96	16,000,000.00	-
600584	长电科技	2014/11/03	重大事项	11.13	2015/01/14	12.24	300,000	3,413,999.00	3,339,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本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 502,699,984.70 元。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	404,526,430.85	19.13
	其中：股票	404,526,430.85	19.13
2	固定收益投资	1,508,213,544.27	71.34
	其中：债券	1,508,213,544.27	71.34
	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	170,225,873.56	8.05

7	其他资产	31,239,560.77	1.48
8	合计	2,114,205,409.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	3,548,000.00	0.23
C	制造业	59,706,812.72	3.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	14,867,000.00	0.94
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	16,000,000.00	1.02
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,118,400.00	1.78
J	金融业	207,481,265.20	13.17
K	房地产业	69,260,952.93	4.40
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	5,544,000.00	0.35
	合计	404,526,430.85	25.68

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	600036	招商银行	4,999,889	82,948,158.51	5.27
2	600185	格力地产	1,800,001	39,600,022.00	2.51
3	601688	华泰证券	1,399,949	34,256,752.03	2.17
4	002544	杰赛科技	1,010,000	28,118,400.00	1.78
5	000728	国元证券	740,098	23,068,854.66	1.46
6	601336	新华保险	450,000	22,302,000.00	1.42
7	002465	海格通信	1,000,000	19,320,000.00	1.23
8	600266	北京城建	800,099	18,930,342.34	1.20
9	601166	兴业银行	1,000,000	16,500,000.00	1.05

10	600428	中远航运	2,000,000	16,000,000.00	1.02
----	--------	------	-----------	---------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600109	国金证券	92,121,885.26	5.85
2	600036	招商银行	69,200,892.80	4.39
3	601989	中国重工	43,011,826.88	2.73
4	600185	格力地产	42,144,440.77	2.68
5	600325	华发股份	38,866,897.66	2.47
6	600266	北京城建	31,628,151.62	2.01
7	000728	国元证券	30,761,588.16	1.95
8	600820	隧道股份	30,539,942.02	1.94
9	002544	杰赛科技	29,194,881.74	1.85
10	601166	兴业银行	26,549,243.63	1.69
11	601688	华泰证券	26,135,489.56	1.66
12	002073	软控股份	25,082,276.80	1.59
13	002465	海格通信	24,518,147.52	1.56
14	002094	青岛金王	23,019,578.83	1.46
15	600030	中信证券	20,912,891.63	1.33
16	000776	广发证券	20,366,547.33	1.29
17	002285	世联行	20,304,161.71	1.29
18	000507	珠海港	18,674,845.51	1.19
19	600064	南京高科	18,359,792.63	1.17
20	601628	中国人寿	17,415,886.68	1.11

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600109	国金证券	111,609,046.88	7.08

2	601989	中国重工	42,244,123.43	2.68
3	600030	中信证券	32,546,054.26	2.07
4	600820	隧道股份	30,994,568.28	1.97
5	600325	华发股份	28,554,840.96	1.81
6	601555	东吴证券	27,351,962.30	1.74
7	002073	软控股份	24,806,586.22	1.57
8	002285	世联行	24,216,116.89	1.54
9	000728	国元证券	23,345,983.00	1.48
10	002094	青岛金王	22,516,051.85	1.43
11	002673	西部证券	20,183,208.51	1.28
12	600266	北京城建	19,894,792.20	1.26
13	000712	锦龙股份	19,673,109.80	1.25
14	601628	中国人寿	18,827,460.20	1.20
15	600064	南京高科	17,561,966.28	1.11
16	000507	珠海港	17,411,925.02	1.11
17	002051	中工国际	15,172,606.10	0.96
18	000001	平安银行	14,941,025.95	0.95
19	000024	招商地产	12,658,305.93	0.80
20	601166	兴业银行	12,658,279.22	0.80

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,100,036,962.52
卖出股票收入（成交）总额	815,283,806.04

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	723,814.50	0.05
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	157,544,700.00	10.00
	其中：政策性金融债	157,544,700.00	10.00
4	企业债券	315,063,380.50	20.00
5	企业短期融资券	30,189,000.00	1.92
6	中期票据	95,845,500.00	6.08
7	可转债	908,847,149.27	57.69
8	其他	-	0.00

9	合计	1,508,213,544.27	95.73
---	----	------------------	-------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110027	东方转债	1,000,000	171,210,000.00	10.87
2	113001	中行转债	1,000,000	156,590,000.00	9.94
3	113005	平安转债	700,000	126,294,000.00	8.02
4	110023	民生转债	736,190	101,792,991.30	6.46
5	140208	14 国开 08	700,000	71,953,000.00	4.57

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	283,497.84
2	应收证券清算款	10,902,754.69
3	应收股利	-
4	应收利息	19,095,153.14
5	应收申购款	958,155.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,239,560.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	156,590,000.00	9.94
2	113005	平安转债	126,294,000.00	8.02
3	110023	民生转债	101,792,991.30	6.46
4	110020	南山转债	61,428,400.00	3.90
5	110018	国电转债	32,984,000.00	2.09
6	113002	工行转债	29,838,000.00	1.89
7	128005	齐翔转债	19,208,802.16	1.22
8	127002	徐工转债	4,131,849.05	0.26

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600428	中远航运	16,000,000.00	1.02	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	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
1,169	939,004.44	1,035,824,169.89	94.36%	61,872,017.51	5.64%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,270,616.08	0.480%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年6月26日）基金份额总额	695,878,758.69
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	552,109,637.63
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	150,292,208.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,097,696,187.40

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 2014 年 1 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五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2、基金管理人于 2014 年 11 月 28 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五届董事会第三十九次会议审议通过，由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于 2014 年 12 月 20 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五届董事会第三十九次会议审议通过，由刘卓先生任公司董事长及法定代表人，张树忠先生不再担任公司董事长。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付的审计费用为 6 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
光大证券	2	251,114,948.45	14.27%	226,455.93	14.30%	-
招商证券	2	226,792,644.03	12.89%	205,050.92	12.95%	-
北京高华	1	147,134,095.03	8.36%	133,951.57	8.46%	-
兴业证券	2	145,498,879.58	8.27%	128,754.82	8.13%	-
方正证券	1	121,059,320.75	6.88%	110,212.13	6.96%	-
上海证券	1	119,333,627.07	6.78%	108,640.58	6.86%	-
长城证券	2	98,903,852.75	5.62%	90,041.89	5.68%	-
银河证券	4	95,515,674.93	5.43%	85,342.10	5.39%	-
宏源证券	1	78,676,267.72	4.47%	69,622.66	4.40%	-
国泰君安	2	73,304,174.01	4.17%	64,868.50	4.10%	-
国金证券	2	70,629,638.24	4.01%	62,501.06	3.95%	-
安信证券	1	65,244,712.56	3.71%	59,398.48	3.75%	-
南京证券	1	60,070,800.79	3.41%	54,688.59	3.45%	-
平安证券	1	54,739,615.81	3.11%	49,834.21	3.15%	-
国盛证券	1	41,936,144.64	2.38%	37,110.29	2.34%	-
东北证券	2	35,122,418.35	2.00%	31,079.63	1.96%	-
英大证券	1	31,486,440.56	1.79%	28,665.31	1.81%	-
浙商证券	1	25,912,491.71	1.47%	22,929.98	1.45%	-
华创证券	1	16,732,056.18	0.95%	14,806.57	0.93%	-
瑞银证券	1	2,903.04	0.00%	2.64	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	3	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	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
光大证券	143,143,506.05	7.01%	3,365,000,000.00	14.63%
招商证券	634,861,632.66	31.09%	5,090,900,000.00	22.14%
北京高华	39,015,482.10	1.91%	2,607,800,000.00	11.34%
兴业证券	37,322,223.77	1.83%	97,600,000.00	0.42%
方正证券	68,913,958.40	3.37%	30,000,000.00	0.13%
上海证券	497,745,782.83	24.37%	2,704,200,000.00	11.76%
长城证券	126,848,579.10	6.21%	3,609,800,000.00	15.70%
银河证券	-	0.00%	489,500,000.00	2.13%
宏源证券	5,216,408.00	0.26%	11,000,000.00	0.05%
国泰君安	81,365,986.94	3.98%	88,000,000.00	0.38%
国金证券	-	0.00%	14,900,000.00	0.06%
安信证券	94,478,433.60	4.63%	445,000,000.00	1.93%
南京证券	4,186,000.00	0.20%	304,000,000.00	1.32%
平安证券	90,394,347.24	4.43%	1,586,600,000.00	6.90%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	1,499,734.95	0.07%	-	0.00%
英大证券	90,341,768.80	4.42%	1,239,000,000.00	5.39%
浙商证券	-	0.00%	9,000,000.00	0.04%
华创证券	13,668,325.09	0.67%	31,700,000.00	0.14%
瑞银证券	89,332,619.64	4.37%	622,800,000.00	2.71%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%
中信建投	23,796,519.80	1.17%	640,000,000.00	2.78%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%

齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	2,770.10	0.00%	10,900,000.00	0.05%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本基金本报告期末所有席位均为本报告期内新增。本报告期内本基金退租席位：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

大成基金管理有限公司
2015 年 3 月 28 日