

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
2015 年半年度报告摘要
2015 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：2015 年 8 月 27 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 2015 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成 2020 生命周期混合
基金主代码	090006
前端交易代码	090006
后端交易代码	091006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 13 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	3,989,592,305.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和（或）货币市场工具等，通过调整资产配置策略和精选证券，以超越业绩比较基准，寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在 2020 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2020 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。
投资策略	本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化，将纪律性和科学性结合起来，建立较全面的资产、个股投资价值评价体系，不断优化投资组合配置。本基金的投资策略分为两个层次：第一个层次是资产配置策略，即在权益类、固定收益证券和货币市场工具之间的配置比例；第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。
业绩比较基准	基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日：75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日：45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日：25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 2021 年 1 月 1 日以及该日以后：10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于生命周期型基金，2020 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日止，本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票基金；随着目标日期的临近，本基金逐步发展为一只低风险

	债券型基金。
--	--------

注：大成基金管理有限公司根据《大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2011 年 1 月 1 日起，大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金使用的业绩比较基准由原“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×新华富时中国 A600 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×新华富时中国 A600 指数+75%×中国债券总指数
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×新华富时中国 A600 指数+90%×中国债券总指数

”变更为“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数

”

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

2.4 信息披露方式

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	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 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	2,064,351,350.72
本期利润	2,115,006,676.98
加权平均基金份额本期利润	0.3082
本期基金份额净值增长率	36.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1209
期末基金资产净值	3,507,053,368.20
期末基金份额净值	0.879

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。

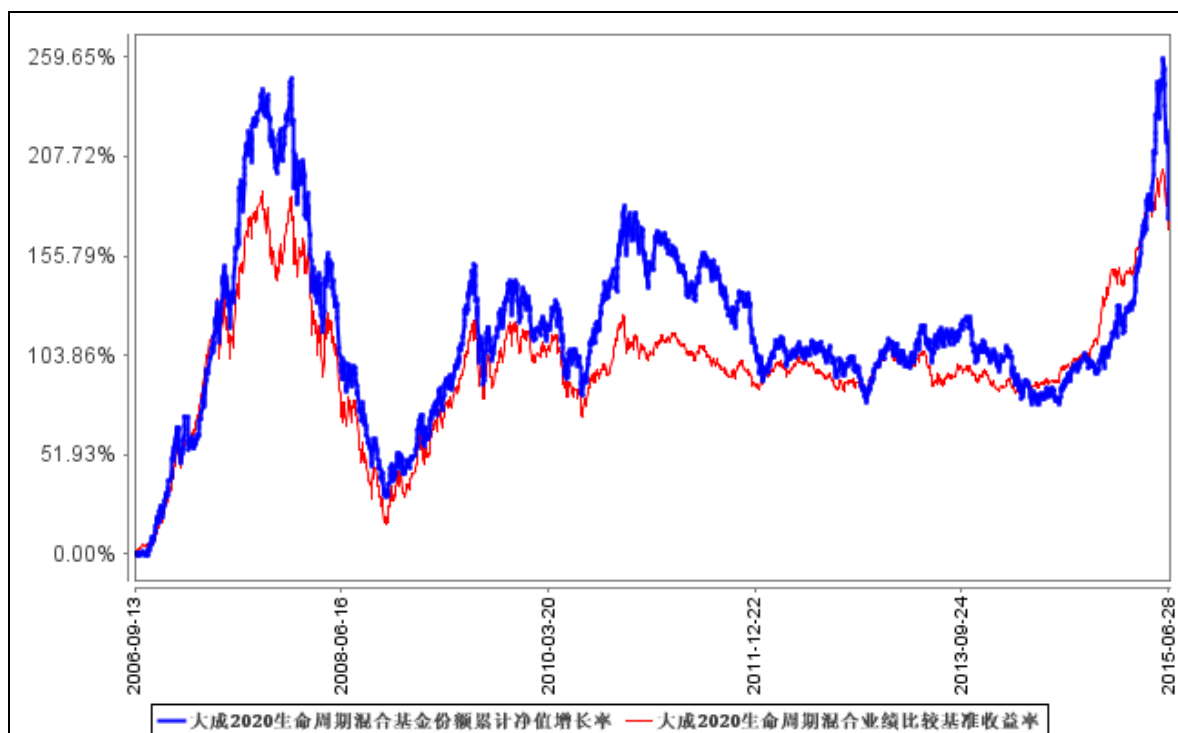
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-12.36%	2.88%	-3.03%	1.57%	-9.33%	1.31%
过去三个月	13.42%	2.21%	6.42%	1.18%	7.00%	1.03%
过去六个月	36.49%	1.77%	13.64%	1.02%	22.85%	0.75%
过去一年	53.94%	1.38%	45.86%	0.83%	8.08%	0.55%
过去三年	37.77%	1.15%	42.04%	0.68%	-4.27%	0.47%
自基金合同生效起至今	186.67%	1.53%	178.21%	1.28%	8.46%	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：1. 自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告日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。

2. 按基金合同规定，本基金各个时间段的资产配置比例如下：

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	0—95%	5%—100%
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	0—75%	25%—100%
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	0—50%	50%—100%
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	0—20%	80%—100%

§ 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 2015 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 51 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及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 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		
周德昕先生	本基金基金经理	2014 年 6 月 26 日	-	13 年	财务管理学硕士。曾任职于哈里投资有限公司、新疆证券有限责任公

					<p>司及广发证券股份有限公司，从事投资研究工作。2007年3月至2012年3月任职于招商基金管理有限公司，历任高级研究员、研究组长、助理基金经理及招商大盘蓝筹股票型证券投资基金及招商中小盘精选股票型证券投资基金基金经理。</p> <p>2012年4月至2014年4月任职于安信证券股份有限公司，历任证券投资部执行总经理及资产管理部副总经理。2014年4月加入大成基金管理有限公司，现任股票投资部成长组投资总监。2014年6月26日起任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理。2015年5月23日至2015年7月2日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理，2015年7月3日起任大成新锐产业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>
侯春燕女士	本基金基金经理助理	2015年3月30日	-	5年	<p>经济学硕士，2010年6月加入大成基金管理有限公司。2012年11月8日至2015年3月30日担任景宏证券投资基金基金经理助理（该基金于2014年4月10日转型成为大成中小盘股票型证券投资基金（LOF））。2012年11月8日至2013年3月11日担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2013年3月11日至2015年3月30日担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理助理。2015年3月30日起担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
魏庆国先生	本基金基金经理助理	2014年10月28日	2015年3月30日	6年	<p>经济学硕士。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员；2012年至2013年任职于平安大华基金研究部；2013年5月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理助理。2015</p>

					年 4 月 7 日至 2015 年 7 月 23 日起担任大成中小盘股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 7 月 24 日起任大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2015 年 4 月 7 日起任及大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 28 日起任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。
--	--	--	--	--	--

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》、《大成财富管理 2020 生命周期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, 大成财富管理 2020 生命周期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。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 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,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 1 笔,原因为投资策略需要;投资组合间存在 1 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

国内宏观经济上半年持续下滑,通胀水平也维持在低位,虽然央行连续降息降准,但由于金融体系利率水平和实体经济利率水平传导机制不顺畅,货币政策的宽松对实体经济的刺激不明显,而过于充裕的流动性大部分进入股市。

流动性的极度充裕和投资者持续加杠杆的投机行为推动股市快速上涨,概念股横飞及泡沫严重,由此引发了监管部门的担忧,着手在多方面进行干预。在此背景下,上半年 A 股市场在经历了大幅上涨之后急速下跌:上证综指一路上冲到 5229 点,但由于投机氛围过于严重以及存在的恶意做空行为,在清理杠杆的影响下,6 月份最后两周内市场急速暴跌,形成罕见的跌幅。本组合明显跑赢基准,超额收益主要来自我们在国企改革、医药、农业信息化、传媒等板块的个股选择。

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 0.879 元,本报告期基金份额净值增长率为 36.49%,同期业绩比较基准收益率为 13.64%,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

虽然短期经济仍然较为疲弱,但随着稳增长政策的不断加码,房地产销售的持续回暖和地方政府债务置换的快速推进,房地产和基建投资企稳回升带动终端需求复苏,有望推动生产面出现企稳格局。产业结构升级和国企改革是未来几年振兴中国的主线,国家在政策上一定会进行大力支持,很多龙头企业也已经在新的方向上做了大力投入。因此,我们对中国的经济和改革前途仍保持乐观态度。

面对这次罕见的股价暴跌,也说明我国的资本市场仍显年轻,在很多金融创新工具的使用上仍有很多不足,因为也仅仅是工具性的问题,而非经济和改革前途出了问题,我们有充分理由相信,我们政府能成功应对这次股市危机。

由降杠杆引发票股市场在短期内出现急速下跌,市场整体估值体系也面临着重构,很多估值合理的优质个股也会被错杀。因此,在下半年的投资策略上,我们会挑选长期空间广阔、商业模

式清晰且估值合理的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金（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：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	561,935,553.59	276,943,706.73
结算备付金	6,795,219.83	7,587,202.76
存出保证金	3,357,241.08	1,562,151.00
交易性金融资产	3,008,447,039.10	5,016,811,126.09
其中：股票投资	2,278,947,539.10	3,631,488,388.19
基金投资	-	-
债券投资	729,499,500.00	1,385,322,737.90
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	22,000,253.00	471,222,066.83

应收证券清算款	-	113,933,361.51
应收利息	12,779,887.71	13,147,108.09
应收股利	-	-
应收申购款	718,765.79	48,083.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,616,033,960.10	5,901,254,806.04
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年6月30日	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	-	480,000,000.00
应付证券清算款	70,653,254.82	63,471,893.23
应付赎回款	21,303,281.84	6,874,644.15
应付管理人报酬	5,237,223.13	6,354,503.13
应付托管费	935,218.40	1,134,732.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,184,921.42	7,362,840.87
应交税费	34,923.20	34,923.20
应付利息	-	19,516.11
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	631,769.09	730,577.48
负债合计	108,980,591.90	565,983,630.86
所有者权益:		
实收基金	3,989,592,305.35	8,283,184,510.94
未分配利润	-482,538,937.15	-2,947,913,335.76
所有者权益合计	3,507,053,368.20	5,335,271,175.18
负债和所有者权益总计	3,616,033,960.10	5,901,254,806.04

注:报告截止日 2015 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.879 元,基金份额总额 3,989,592,305.35 份。

6.2 利润表

会计主体:大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

本报告期:2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	2,196,015,540.91	-546,981,582.98
1. 利息收入	20,165,126.51	19,497,778.40
其中:存款利息收入	2,188,478.61	3,795,897.01

债券利息收入	14,894,628.36	11,867,111.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,082,019.54	3,834,769.62
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,122,180,173.91	-193,941,922.05
其中：股票投资收益	1,910,456,125.95	-202,378,873.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	198,118,699.23	-17,255,648.12
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	13,605,348.73	25,692,599.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	50,655,326.26	-372,853,015.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,014,914.23	315,576.01
减：二、费用	81,008,863.93	62,843,049.76
1. 管理人报酬	37,932,692.70	41,325,902.62
2. 托管费	6,773,695.17	7,379,625.44
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	34,992,533.53	13,832,670.62
5. 利息支出	1,003,366.37	-
其中：卖出回购金融资产支出	1,003,366.37	-
6. 其他费用	306,576.16	304,851.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,115,006,676.98	-609,824,632.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,115,006,676.98	-609,824,632.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,283,184,510.94	-2,947,913,335.76	5,335,271,175.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,115,006,676.98	2,115,006,676.98

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）	-4,293,592,205.59	350,367,721.63	-3,943,224,483.96
其中：1. 基金申购款	95,842,545.18	-9,806,321.03	86,036,224.15
2. 基金赎回款	-4,389,434,750.77	360,174,042.66	-4,029,260,708.11
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）	3,989,592,305.35	-482,538,937.15	3,507,053,368.20
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	10,497,945,519.47	-3,883,859,413.54	6,614,086,105.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-609,824,632.74	-609,824,632.74
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）	-692,380,370.86	284,756,005.58	-407,624,365.28
其中：1. 基金申购款	22,765,638.67	-9,393,626.39	13,372,012.28
2. 基金赎回款	-715,146,009.53	294,149,631.97	-420,996,377.56
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）	9,805,565,148.61	-4,208,928,040.70	5,596,637,107.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀
基金管理人负责人

肖剑
主管会计工作负责人

范瑛
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 会计政策和会计估计变更的说明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.2.2 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
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。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	532,549,380.38	2.43%	599,717,738.02	6.69%

6.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	481,794.81	2.45%	105,446.76	1.04%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	531,393.13	6.62%	324,871.01	8.52%

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。

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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	37,932,692.70
其中：支付销售机构的客户维护费	5,630,642.57	6,100,921.42

注：自基金合同生效日起至 2010 年 12 月 31 日止，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；自 2011 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止，管理费年费率变更为 1.4%。管理费逐日计提，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 管理费年费率 / 当年天数。

6.4.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,773,695.17	7,379,625.44

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.3.3 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 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	989,800,000.00	570,913.10
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间除基金管理人之外的其他各关联方无投资本基金的情况。

6.4.3.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014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	561,935,553.59	2,007,305.61	194,202,725.89	3,734,335.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.3.6 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。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.4 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.4.2 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
002044	江苏三友	15-6-18	重大事项停牌	44.80	15-7-1	49.50	26,800	1,629,062.00	1,200,640.00	-
002375	亚厦股份	15-6-17	重大事项停牌	23.96	15-7-20	26.29	207,021	5,686,825.50	4,960,223.16	-
002605	姚记扑克	15-6-16	重大事项停牌	21.26	-	-	108,989	2,873,233.05	2,317,106.14	-
600872	中炬高新	15-5-4	重大事项停牌	23.16	-	-	12,922,724	208,771,756.77	299,290,287.84	-

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	2,278,947,539.10	63.02

	其中：股票	2,278,947,539.10	63.02
2	固定收益投资	729,499,500.00	20.17
	其中：债券	729,499,500.00	20.17
	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	22,000,253.00	0.61
	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	568,730,773.42	15.73
7	其他各项资产	16,855,894.58	0.47
8	合计	3,616,033,960.10	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	19,695,260.00	0.56
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	896,529,180.36	25.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	5,930,765.16	0.17
F	批发和零售业	256,373,035.00	7.31
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	23,632,825.00	0.67
J	金融业	2,829.05	0.00
K	房地产业	219,090,293.87	6.25
L	租赁和商务服务业	319,784,402.40	9.12
M	科学研究和技术服务业	7,307,249.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	319,918,703.94	9.12
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	210,682,995.32	6.01
S	综合	-	0.00
	合计	2,278,947,539.10	64.98

7.3 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	000826	桑德环境	8,226,127	319,914,079.03	9.12
2	000061	农产品	15,675,706	319,784,402.40	9.12
3	600872	中炬高新	12,922,724	299,290,287.84	8.53
4	000816	智慧农业	26,866,157	277,796,063.38	7.92
5	600655	豫园商城	15,715,980	252,241,479.00	7.19
6	600565	迪马股份	17,527,159	212,604,438.67	6.06
7	300027	华谊兄弟	5,523,938	210,682,995.32	6.01
8	002614	蒙发利	10,559,976	188,284,372.08	5.37
9	000848	承德露露	6,456,564	117,509,464.80	3.35
10	000503	海虹控股	451,045	22,101,205.00	0.63

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>）的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	576,933,496.81	10.81
2	000002	万科A	575,226,847.81	10.78
3	002614	蒙发利	572,055,622.88	10.72
4	600565	迪马股份	415,093,102.33	7.78
5	300027	华谊兄弟	379,379,445.50	7.11
6	000826	桑德环境	356,723,803.34	6.69
7	600713	南京医药	349,747,566.81	6.56
8	000061	农产品	313,633,848.30	5.88
9	600655	豫园商城	299,539,746.16	5.61
10	600219	南山铝业	240,524,551.84	4.51
11	600872	中炬高新	230,741,233.54	4.32
12	600739	辽宁成大	223,330,225.87	4.19
13	600887	伊利股份	205,665,992.41	3.85

14	000685	中山公用	176,372,856.47	3.31
15	600048	保利地产	154,834,587.66	2.90
16	600535	天士力	153,243,300.41	2.87
17	601166	兴业银行	147,894,598.69	2.77
18	601899	紫金矿业	130,397,674.63	2.44
19	600418	江淮汽车	128,737,907.34	2.41
20	600383	金地集团	123,548,162.69	2.32
21	000816	智慧农业	120,972,240.80	2.27
22	002223	鱼跃医疗	118,485,808.14	2.22
23	600039	四川路桥	116,793,841.92	2.19
24	600089	特变电工	115,450,018.63	2.16
25	000338	潍柴动力	113,776,815.92	2.13
26	000423	东阿阿胶	113,718,856.98	2.13
27	601258	庞大集团	112,319,511.65	2.11

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601318	中国平安	636,514,229.09	11.93
2	002614	蒙发利	625,556,722.82	11.72
3	000002	万科A	623,995,347.49	11.70
4	600535	天士力	563,041,016.70	10.55
5	600016	民生银行	466,332,902.48	8.74
6	000816	智慧农业	465,771,170.18	8.73
7	002241	歌尔声学	438,763,429.99	8.22
8	600055	华润万东	385,362,628.29	7.22
9	300027	华谊兄弟	350,554,033.29	6.57
10	000848	承德露露	321,004,820.77	6.02
11	000988	华工科技	297,363,250.71	5.57
12	600887	伊利股份	287,084,336.01	5.38
13	600713	南京医药	280,116,681.16	5.25
14	600739	辽宁成大	279,617,011.09	5.24
15	000963	华东医药	275,689,929.45	5.17
16	600872	中炬高新	250,321,660.99	4.69

17	002230	科大讯飞	235,252,181.24	4.41
18	600219	南山铝业	232,972,038.58	4.37
19	601166	兴业银行	220,240,156.79	4.13
20	600585	海螺水泥	209,392,971.27	3.92
21	000685	中山公用	194,611,901.37	3.65
22	002223	鱼跃医疗	167,286,155.02	3.14
23	000826	桑德环境	158,075,394.54	2.96
24	600565	迪马股份	156,314,532.09	2.93
25	600383	金地集团	153,932,408.88	2.89
26	600418	江淮汽车	149,366,291.82	2.80
27	601258	庞大集团	147,179,542.52	2.76
28	000423	东阿阿胶	139,428,112.16	2.61
29	002065	东华软件	138,583,285.84	2.60
30	600048	保利地产	137,972,687.51	2.59
31	300124	汇川技术	135,989,140.01	2.55
32	600557	康缘药业	125,953,351.47	2.36
33	600039	四川路桥	125,304,043.04	2.35
34	601899	紫金矿业	124,985,172.46	2.34
35	000069	华侨城 A	123,668,610.91	2.32
36	000402	金融街	122,422,903.39	2.29
37	600525	长园集团	120,967,141.62	2.27
38	000338	潍柴动力	118,417,813.14	2.22
39	600089	特变电工	113,633,886.15	2.13
40	300058	蓝色光标	109,633,032.02	2.05

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	9,415,399,297.31
卖出股票收入（成交）总额	12,909,157,143.25

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	361,278,000.00	10.30

	其中：政策性金融债	361,278,000.00	10.30
4	企业债券	5,189,500.00	0.15
5	企业短期融资券	330,578,000.00	9.43
6	中期票据	32,454,000.00	0.93
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	729,499,500.00	20.80

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	120239	12 国开 39	3,000,000	300,990,000.00	8.58
2	041562020	15 沪世茂 CP002	1,400,000	140,126,000.00	4.00
3	011586005	15 光明 SCP005	500,000	50,145,000.00	1.43
4	011528003	15 北车 SCP003	500,000	49,945,000.00	1.42
5	100236	10 国开 36	400,000	40,208,000.00	1.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现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	3,357,241.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,779,887.71
5	应收申购款	718,765.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,855,894.58

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
213,796	18,660.74	3,975,661.77	0.10%	3,985,616,643.58	99.90%

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	3,965.21	0.0001%

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（2006年9月13日）基金份额总额	1,112,964,439.35
本报告期期初基金份额总额	8,283,184,510.94
本报告期基金总申购份额	95,842,545.18
减：本报告期基金总赎回份额	4,389,434,750.77
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	3,989,592,305.35

§ 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 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。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 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六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 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七次会议审议通过，肖冰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

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	23	23,957,669,479.46	18.09%	3,525,855.41	17.96%	-
东海证券	13	213,533,690.28	14.69%	2,925,591.96	14.90%	-
海通证券	22	185,976,897.67	9.99%	1,990,104.02	10.14%	-
招商证券	21	737,812,541.06	7.94%	1,540,418.15	7.85%	-
申银万国	11	272,329,075.08	5.82%	1,125,892.37	5.73%	-
广发证券	11	107,897,610.13	5.06%	1,008,627.65	5.14%	-
国信证券	11	1,011,810,387.80	4.62%	895,357.46	4.56%	-
民族证券	1	944,998,953.85	4.32%	836,232.18	4.26%	-
长城证券	1	912,296,657.74	4.17%	807,298.64	4.11%	-
国泰君安	1	785,658,391.17	3.59%	695,236.09	3.54%	-
中信证券	2	737,801,460.94	3.37%	671,694.16	3.42%	-
长江证券	1	687,925,353.18	3.14%	626,287.95	3.19%	-
民生证券	1	638,539,776.77	2.92%	565,041.83	2.88%	-
中投证券	3	618,797,050.61	2.83%	563,352.60	2.87%	-
光大证券	2	532,549,380.38	2.43%	481,794.81	2.45%	-
东方证券	1	350,143,019.39	1.60%	318,770.09	1.62%	-
中金公司	2	319,595,871.28	1.46%	282,812.36	1.44%	-
华泰证券	2	243,100,344.46	1.11%	215,122.21	1.10%	-
国海证券	1	208,820,048.02	0.95%	184,784.30	0.94%	-
银河证券	1	194,626,660.48	0.89%	177,188.58	0.90%	-
华鑫证券	1	151,584,912.63	0.69%	138,002.92	0.70%	-
国都证券	1	66,044,202.79	0.30%	58,443.39	0.30%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万和证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东莞证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、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。

2、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：

本报告期内增加交易单元：长城证券；

本报告期内退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	1,042.30	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

东海证券	318,659,927.80	22.42%	80,000,000.00	10.81%	-	0.00%
海通证券	585,857,061.90	41.21%	30,000,000.00	4.05%	-	0.00%
广发证券	428,550,554.50	30.14%	300,000,000.00	40.54%	-	0.00%
国信证券	23,747,387.24	1.67%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	330,000,000.00	44.59%	-	0.00%
长江证券	64,820,805.12	4.56%	-	0.00%	-	0.00%

大成基金管理有限公司
2015年8月27日