

大成景利混合型证券投资基金  
2015 年半年度报告  
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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 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。

基金托管人中国工商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。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>45</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>45</b>
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	大成景利混合型证券投资基金
基金简称	大成景利混合
基金主代码	000865
交易代码	000865
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 9 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,304,076,639.57 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，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，在资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。
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	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	蒋松云
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		刘卓	姜建清

## 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	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 55 号中国工商银行托管业务部

## 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	202,032,557.23
本期利润	231,663,015.42
加权平均基金份额本期利润	0.0655
本期加权平均净值利润率	6.09%
本期基金份额净值增长率	4.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,172,030,338.55
期末可供分配基金份额利润	0.0953
期末基金资产净值	13,476,106,978.12
期末基金份额净值	1.095
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.50%

注：1、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）。

2、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。

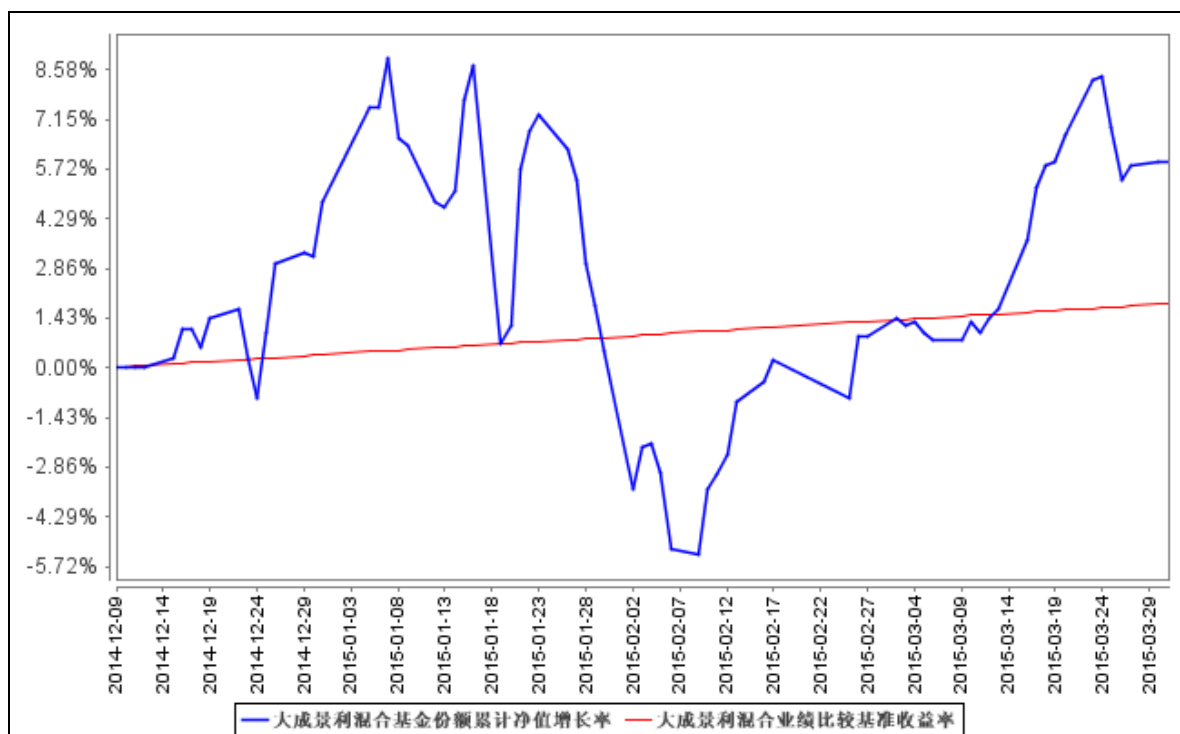
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.83%	0.08%	0.44%	0.01%	0.39%	0.07%
过去三个月	3.40%	0.07%	1.37%	0.01%	2.03%	0.06%
过去六个月	4.48%	1.16%	2.84%	0.02%	1.64%	1.14%
自基金合同生效起至今	9.50%	1.13%	3.23%	0.02%	6.27%	1.11%

#### 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、本基金合同生效日为 2014 年 12 月 9 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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		
王磊先生	本基金基 金经理	2014 年 12 月 9 日	-	11 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 日至 2015 年 7 月 15 日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 7 月 16 日起任大成强化收益定期开放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

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》、《大成景利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，大成景利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。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

2015 年上半年债券市场表现良好。今年上半年以来，在经济结构转型和产能过剩大背景下，经济增长动力不足，经济增速有下滑出区间调控的风险，央行频频动用价格和数量工具放松货币，银行间市场资金面非常宽松，债券收益率大幅下行。整体上看，中债综合财富总指数上涨 3.11%。

股票方面，市场延续去年下半年开始的牛市行情，虽然 6 月中旬开始出现大幅回调，但上半年整体走势仍然靓丽，尤其是以成长性著称的创业板和中小板涨势惊人。可转债受 6 月下旬暴跌影响，上半年整体收跌。从指数来看，上证 50 涨 11.17%，沪深 300 涨 26.58%，中小板涨 69.06%，

创业板涨 94.23%，中证转债指数跌 11.98%。

操作上，本组合根据资本市场走势和货币政策变化，灵活调整债券和权益类组合结构，同时抓住一级市场新股申购机会，加大参与力度，为持有人获得了稳定持续的回报。

#### 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 1.095 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.48%，同期业绩比较基准收益率为 2.84%，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 年下半年，我们对债券市场保持乐观。稳增长、调结构和经济转型仍然是经济主基调，在消化过剩产能和房地产周期下滑拖累下，经济下行压力较大，新的经济增长点虽然有所抬头，但对冲经济下滑稍显不足，稳增长仍然需要保持较宽松的货币政策。另外，国际经济形势错综复杂、复苏乏力，原油等大宗商品低位运行，国内资本市场出现回调震荡，债券市场整体面临较好发展环境。整体看，我们看好下半年债市表现。

我们认为，股票市场经过今年 6 月中旬以来去杠杆的快速下跌，不少上市公司已经具有中长期的投资价值，但短期市场的系统性下跌和恐慌因素导致市场流动性的缺失，市场人气的恢复还需要较长的时间。但中期看，市场仍然具有积极向好基础，经过这次深度调整后，平稳健康发展的“慢牛”值得期待。我们坚定看好资本市场发展机会。

下半年，我们将进一步加大市场投研分析，增加组合操作灵活性，在保证组合流动性前提下，提升债券类仓位，灵活控制权益类仓位。目前市场处于比较艰难的调整期，等市场调整结束后，择机适度增加权益类配置。同时在新股重启后，继续较大力度参与一级申购交易，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

无。

#### 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，本基金托管人在对大成景利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，大成景利混合型证券投资基金的托管人——大成基金管理有限公司在大成景利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成景利混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成景利混合型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：大成景利混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,801,800,631.32	247,809,588.07
结算备付金		357,129.01	-
存出保证金		331,582.65	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,460,304,125.64	605,798,012.51
其中：股票投资		238,217,234.84	217,739,877.51
基金投资		-	-
债券投资		1,222,086,890.80	388,058,135.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,083,158,570.02	-
应收证券清算款		122,897,111.48	3,414,340.69
应收利息	6.4.7.5	19,420,394.12	2,498,030.07
应收股利		-	-
应收申购款		93,695.82	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,488,363,240.06	859,519,971.34

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,172,041.98	-
应付管理人报酬		7,782,724.76	449,537.13
应付托管费		2,161,867.98	124,871.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	942,615.06	348,903.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	197,012.16	5,335.08
负债合计		12,256,261.94	928,647.21
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,304,076,639.57	819,423,071.18
未分配利润	6.4.7.10	1,172,030,338.55	39,168,252.95
所有者权益合计		13,476,106,978.12	858,591,324.13
负债和所有者权益总计		13,488,363,240.06	859,519,971.34

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.095 元，基金份额总额 12,304,076,639.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：大成景利混合型证券投资基金

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	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		256,849,826.26
1. 利息收入		34,715,565.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,005,907.78
债券利息收入		9,009,724.85
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		10,699,932.76
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		189,574,127.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	147,300,067.53

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	41,965,658.50
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	308,401.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	29,630,458.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,929,675.03
<b>减：二、费用</b>		25,186,810.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,836,952.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,676,931.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,176,993.27
5. 利息支出		1,272,365.67
其中：卖出回购金融资产支出		1,272,365.67
6. 其他费用	6.4.7.20	223,568.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		231,663,015.42
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		231,663,015.42

注：本基金合同生效日为 2014 年 12 月 9 日，本报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止。截至报告日，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，下同。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景利混合型证券投资基金

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）	819,423,071.18	39,168,252.95	858,591,324.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	231,663,015.42	231,663,015.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	11,484,653,568.39	901,199,070.18	12,385,852,638.57

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	12,353,073,579.64	955,256,253.95	13,308,329,833.59
2. 基金赎回款	-868,420,011.25	-54,057,183.77	-922,477,195.02
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)	12,304,076,639.57	1,172,030,338.55	13,476,106,978.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成景利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 1121 号《关于核准大成景利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《大成景利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 819,230,633.92 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 779 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成景利混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 819,423,071.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 192,437.26 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成景利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,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)。基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产净值的比例不超过 30%,债券、货币市场工具(含现金)等固定收益类金融工具占基金资产净值的比例不低于 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%。



#### 6.4.2 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》、《大成景利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 06 月 30 日的财务状况以及 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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和债券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、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（3）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。

（4）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），按照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

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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2015年6月30日
活期存款	501,800,631.32
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	6,300,000,000.00
合计：	6,801,800,631.32

注：其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2015年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	173,720,379.35	238,217,234.84	64,496,855.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,756,033.70	3,023,890.80	267,857.10
	银行间市场	1,214,535,898.36	1,219,063,000.00	4,527,101.64
	合计	1,217,291,932.06	1,222,086,890.80	4,794,958.74
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,391,012,311.41	1,460,304,125.64	69,291,814.23	

## 6.4.7.3 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。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	5,083,158,570.02	-
合计	5,083,158,570.02	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	120,599.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	3,895,555.56
应收结算备付金利息	144.72
应收债券利息	11,037,240.48
应收买入返售证券利息	4,366,719.17
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	134.28
合计	19,420,394.12

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	865,803.23
银行间市场应付交易费用	76,811.83
合计	942,615.06

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	926.61
预提费用	196,085.55
合计	197,012.16

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	819,423,071.18	819,423,071.18
本期申购	12,353,073,579.64	12,353,073,579.64
本期赎回(以“-”号填列)	-868,420,011.25	-868,420,011.25
本期末	12,304,076,639.57	12,304,076,639.57

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	-493,103.09	39,661,356.04	39,168,252.95
本期利润	202,032,557.23	29,630,458.19	231,663,015.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,246,044,105.76	-344,845,035.58	901,199,070.18
其中：基金申购款	1,279,971,801.03	-324,715,547.08	955,256,253.95
基金赎回款	-33,927,695.27	-20,129,488.50	-54,057,183.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,447,583,559.90	-275,553,221.35	1,172,030,338.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	2,696,386.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,272,983.34
结算备付金利息收入	34,587.45
其他	1,950.86
合计	15,005,907.78

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	859,449,247.21
减：卖出股票成本总额	712,149,179.68
买卖股票差价收入	147,300,067.53

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------



卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	928,740,180.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	878,014,777.23
减：应收利息总额	8,759,744.30
买卖债券差价收入	41,965,658.50

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	308,401.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	308,401.62

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	29,630,458.19
——股票投资	58,729,611.88
——债券投资	-29,099,153.69
——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	29,630,458.19

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	2,929,663.03
其他	12.00
合计	2,929,675.03

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	2,166,193.27
银行间市场交易费用	10,800.00
合计	2,176,993.27

#### 6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	41,984.76
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	29,818.27
中债登债券托管帐户维护费	3,000.00
合计	223,568.74

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构
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”)	基金管理人的全资子公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	16,836,952.08
其中：支付销售机构的客户维护费	1,002,819.57

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 0.9%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.9\% / \text{当年天数}。$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	4,676,931.08

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.3 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。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.10.4.2 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

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额 (份)	持有的基金份额 占基金总份 额比例	持有的基 金份额 (份)	持有的基金份额 占基金总份 额比例
中泰信托有限责任公司	220,962,228.52	1.7959%	-	-
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	-	-	-	-
中国银河投资管理有限公司	-	-	-	-
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	-	-	-	-
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	-	-	-	-
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	-	-	-	-

## 6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	501,800,631.32	2,696,386.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.6 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。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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

300488	恒锋工具	2015/6/25	2015/7/1	新股流通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
--------	------	-----------	----------	--------	-------	-------	-------	------------	------------	---

6.4.12.1.2 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
132002	15天集EB	2015/6/11	2015/7/2	新债流通受限	100.00	100.00	11,210	1,121,000.00	1,121,000.00	-

#### 6.4.12.2 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
300353	东土科技	2015/6/3	重大事项	57.80	-	-	240,000	10,135,503.48	13,872,000.00	-

注：本基金截至 2015 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层

面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

#### 6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

截至 2015 年 6 月 30 日止，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 3.93%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	211,064,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	913,548,000.00	-
合计	1,124,612,000.00	-

##### 6.4.13.2.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	11,318,798.00	241,940,259.20
AAA 以下	75,797,092.80	146,117,875.80

未评级	10,359,000.00	-
合计	97,474,890.80	388,058,135.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金持有的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。于本期末，所持证券均能及时变现。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。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日大部分为一个月以内，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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	6,801,800,631.32	-	-	-	6,801,800,631.32
结算备付金	357,129.01	-	-	-	357,129.01
存出保证金	331,582.65	-	-	-	331,582.65
交易性金融资产	1,136,010,798.00	86,076,092.80	-	238,217,234.84	1,460,304,125.64
买入返售金融资产	5,083,158,570.02	-	-	-	5,083,158,570.02
应收证券清算款	-	-	-	122,897,111.48	122,897,111.48
应收利息	-	-	-	19,420,394.12	19,420,394.12
应收申购款	-	-	-	93,695.82	93,695.82
<b>资产总计</b>	<b>13,021,658,711.00</b>	<b>86,076,092.80</b>	<b>-</b>	<b>380,628,436.26</b>	<b>13,488,363,240.06</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,172,041.98	1,172,041.98
应付管理人报酬	-	-	-	7,782,724.76	7,782,724.76
应付托管费	-	-	-	2,161,867.98	2,161,867.98
应付交易费用	-	-	-	942,615.06	942,615.06
其他负债	-	-	-	197,012.16	197,012.16
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12,256,261.94</b>	<b>12,256,261.94</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>13,021,658,711.00</b>	<b>86,076,092.80</b>	<b>-</b>	<b>368,372,174.32</b>	<b>13,476,106,978.12</b>
<b>上年度末 2014年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	247,809,588.07	-	-	-	247,809,588.07
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	279,017,390.00	108,216,745.00	824,000.00	217,739,877.51	605,798,012.51
应收证券清算款	-	-	-	3,414,340.69	3,414,340.69
应收申购款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,498,030.07	2,498,030.07
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>526,826,978.07</b>	<b>108,216,745.00</b>	<b>824,000.00</b>	<b>223,652,248.27</b>	<b>859,519,971.34</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	449,537.13	449,537.13
应付托管费	-	-	-	124,871.46	124,871.46
应付交易费用	-	-	-	348,903.54	348,903.54
其他负债	-	-	-	5,335.08	5,335.08
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>928,647.21</b>	<b>928,647.21</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>526,826,978.07</b>	<b>108,216,745.00</b>	<b>824,000.00</b>	<b>222,723,601.06</b>	<b>858,591,324.13</b>

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。



## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	利率上升 25 个基准点	-2,486,837.00	-63,217.00
	利率下降 25 个基准点	2,498,918.00	115,572.00

## 6.4.13.4.2 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。

## 6.4.13.4.3 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。

本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金积极、主动地决定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。针对股票投资，本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司；对于新股投资，本基金通过研究首次公开发行股票及增发新股的上市公司基本面因素，分析新股内在价值、市场溢价率、中签率和申购机会成本等综合评估申购收益率，从而制定相应的申购策略以及择时卖出策略；对于债券投资，本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。对于权证投资，本基金以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益；对于股指期货投资，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票等权益类资产占基金资产净值的比例不超过 30%，债券、货币市场工具（含现金）等固定收益类金融工具占基金资产净值的比例不低

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%。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	238,217,234.84	1.77	217,739,877.51	25.36
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	238,217,234.84	1.77	217,739,877.51	25.36

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资比例较低，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 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	238,217,234.84	1.77
	其中：股票	238,217,234.84	1.77
2	固定收益投资	1,222,086,890.80	9.06
	其中：债券	1,222,086,890.80	9.06
	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	5,083,158,570.02	37.69
	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	6,802,157,760.33	50.43
7	其他各项资产	142,742,784.07	1.06
8	合计	13,488,363,240.06	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	484,279.65	0.00
B	采矿业	1,635,059.25	0.01
C	制造业	53,975,086.40	0.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,084,837.96	0.02
E	建筑业	517,786.92	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	75,197,824.02	0.56
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	302,360.64	0.00
J	金融业	103,020,000.00	0.76
K	房地产业	-	0.00
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	-	0.00
	合计	238,217,234.84	1.77

## 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	601211	国泰君安	3,000,000	103,020,000.00	0.76
2	601006	大秦铁路	5,339,920	74,972,476.80	0.56
3	300207	欣旺达	1,000,000	24,220,000.00	0.18
4	300353	东土科技	240,000	13,872,000.00	0.10
5	002651	利君股份	118,399	5,114,836.80	0.04
6	601368	绿城水务	152,547	2,849,577.96	0.02
7	601968	宝钢包装	157,140	2,192,103.00	0.02

8	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.01
9	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.01
10	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.01
11	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.01
12	002761	多喜爱	32,608	965,848.96	0.01
13	002766	索菱股份	25,350	862,153.50	0.01
14	002760	凤形股份	22,488	813,615.84	0.01
15	300472	新元科技	13,626	629,384.94	0.00
16	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.00
17	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.00
18	300479	神思电子	9,600	434,688.00	0.00
19	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.00
20	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.00
21	601985	中国核电	18,000	235,260.00	0.00
22	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.00
23	300482	N 万孚	7,942	182,983.68	0.00
24	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	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	601211	国泰君安	89,757,901.17	10.45
2	601006	大秦铁路	67,686,698.93	7.88
3	600219	南山铝业	30,783,682.46	3.59
4	600325	华发股份	25,798,323.47	3.00
5	600875	东方电气	24,850,000.00	2.89
6	300207	欣旺达	23,250,175.05	2.71
7	601318	中国平安	23,152,045.80	2.70
8	600446	金证股份	23,076,864.08	2.69
9	002285	世联行	23,072,836.08	2.69
10	600048	保利地产	22,178,043.63	2.58
11	600067	冠城大通	21,156,449.66	2.46
12	600795	国电电力	17,784,137.38	2.07
13	600376	首开股份	14,627,162.02	1.70
14	000001	平安银行	14,188,860.00	1.65

15	002230	科大讯飞	13,721,399.09	1.60
16	000802	北京文化	12,394,359.00	1.44
17	601328	交通银行	10,848,000.00	1.26
18	600050	中国联通	10,460,627.00	1.22
19	300353	东土科技	10,135,503.48	1.18
20	601872	招商轮船	9,905,708.00	1.15

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	601211	国泰君安	51,879,921.18	6.04
2	600446	金证股份	33,607,130.50	3.91
3	600219	南山铝业	31,682,995.02	3.69
4	600959	江苏有线	27,420,937.23	3.19
5	600875	东方电气	25,054,971.36	2.92
6	000776	广发证券	24,565,115.58	2.86
7	600325	华发股份	22,430,049.45	2.61
8	600067	冠城大通	21,809,550.45	2.54
9	601688	华泰证券	21,688,299.77	2.53
10	601318	中国平安	21,526,293.61	2.51
11	002285	世联行	20,870,247.04	2.43
12	600048	保利地产	20,096,307.60	2.34
13	002465	海格通信	19,252,271.03	2.24
14	600376	首开股份	18,713,763.78	2.18
15	600795	国电电力	18,277,760.32	2.13
16	000728	国元证券	17,838,093.00	2.08
17	000528	柳 工	16,387,249.07	1.91
18	002544	杰赛科技	15,331,051.17	1.79
19	000001	平安银行	14,736,783.32	1.72
20	000800	一汽轿车	14,637,326.80	1.70

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	673,896,925.13
卖出股票收入（成交）总额	859,449,247.21

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	692,902,000.00	5.14
	其中：政策性金融债	692,902,000.00	5.14
4	企业债券	86,273,092.80	0.64
5	企业短期融资券	442,069,000.00	3.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	842,798.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	1,222,086,890.80	9.07

### 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	150411	15 农发 11	2,000,000	200,860,000.00	1.49
2	150403	15 农发 03	1,800,000	181,098,000.00	1.34
3	150413	15 农发 13	1,500,000	149,895,000.00	1.11
4	041554026	15 国电集 CP002	1,000,000	100,590,000.00	0.75
5	011575001	15 中信股 SCP001	1,000,000	100,560,000.00	0.75

### 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**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

本基金投资的前十名证券之一国泰君安，2015 年 1 月 16 日因“违规为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月”。本基金认为，对国泰君安的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

**7.12.2 本基金投资前十名股票中，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	331,582.65
2	应收证券清算款	122,897,111.48
3	应收股利	-
4	应收利息	19,420,394.12
5	应收申购款	93,695.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,742,784.07

## 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	300353	东土科技	13,872,000.00	0.10	重大事项

## 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
1,232	9,987,075.19	12,241,390,239.69	99.49%	62,686,399.88	0.51%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

## 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	426,337.60	0.0035%

## 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（2014年12月9日）基金份额总额	819,423,071.18
本报告期期初基金份额总额	819,423,071.18
本报告期基金总申购份额	12,353,073,579.64
减：本报告期基金总赎回份额	868,420,011.25
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	12,304,076,639.57

## § 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、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

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、基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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	
中信证券	1	791,650,349.82	61.38%	720,714.30	62.05%	-
申银万国	1	498,038,856.38	38.62%	440,714.61	37.95%	-

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、本基金本报告期内新增席位：无。本报告期内本基金退租席位：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
中信证券	754,350,612.71	99.26%	2,215,600,000.00	100.00%	-	0.00%
申银万国	5,628,686.72	0.74%	-	0.00%	-	0.00%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成景利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/7
2	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	2015/1/7
3	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 绍城改(124159)”债券估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/23
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天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	2015/1/24
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天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	2015/1/24
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏张家港农村商业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	2015/3/7
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州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	2015/3/28
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融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	2015/3/31
10	关于大成景利混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）及基金转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/2
11	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/14

12	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/16
13	大成景利混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/18
14	大成基金管理有限公司关于大成景利混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/27
15	关于大成景利混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）及基金转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/26
16	关于大成景利混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）及基金转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/27
17	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“首开股份”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/27
18	关于大成景利混合型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）及基金转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/10
19	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“东土科技”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/17
20	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	2015/1/13
21	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
22	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
23	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
24	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/28
25	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/30
26	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/2
27	大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
28	大成基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/25
29	大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
30	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	2015/5/5
31	大成基金管理有限公司关于调整网上直销	中国证监会指定报刊	2015/5/8

	通联支付交易费率的公告	及本公司网站	
32	关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/15
33	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/16
34	大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资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	2015/5/19
35	关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/24

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 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景利混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景利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办公住所。

#### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司  
2015年8月27日