

大成景益平稳收益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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<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.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	12
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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34
7.12 投资组合报告附注.....	34

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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.....	35
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	39
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>41</b>
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成景益平稳收益混合型证券投资基金
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	777,887,554.13 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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京东城区建国门内大街 69 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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		刘卓	刘士余

## 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 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

## 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	440,049,984.65
本期利润	184,899,505.79
加权平均基金份额本期利润	0.1909
本期加权平均净值利润率	12.19%
本期基金份额净值增长率	10.66%
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	457,132,818.73
期末可供分配基金份额利润	0.5877
期末基金资产净值	1,235,020,372.86
期末基金份额净值	1.588
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	58.80%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

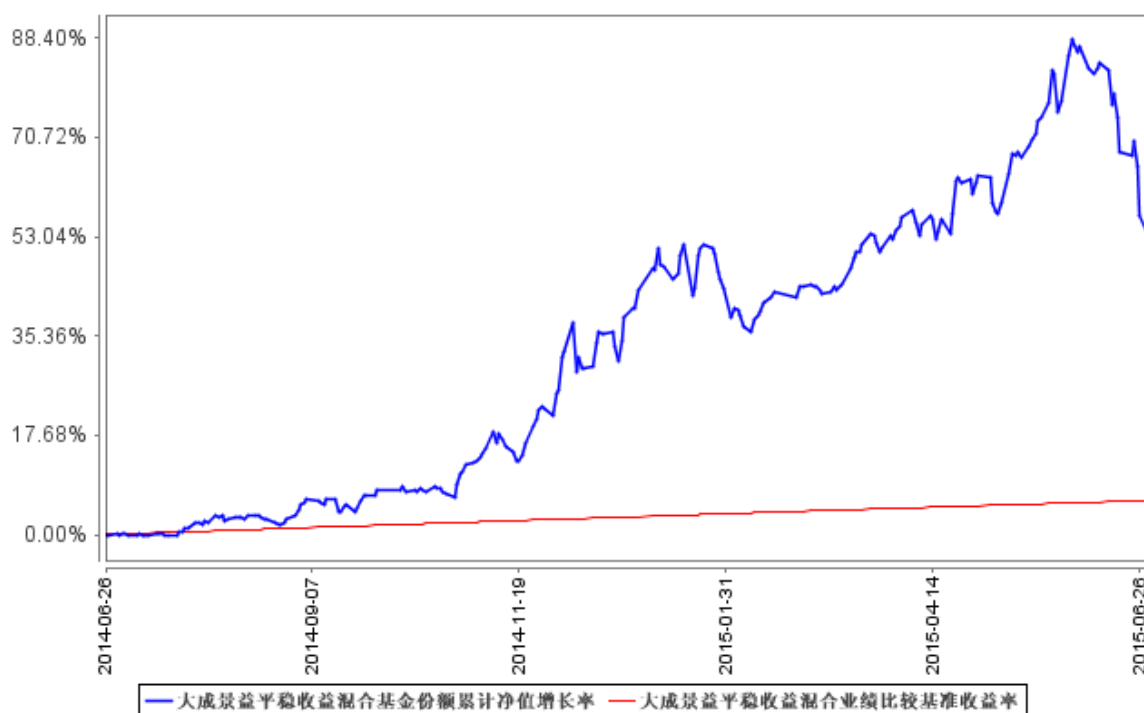
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-10.43%	2.34%	0.45%	0.01%	-10.88%	2.33%
过去三个月	4.13%	1.89%	1.33%	0.01%	2.80%	1.88%
过去六个月	10.66%	1.71%	2.77%	0.02%	7.89%	1.69%
过去一年	58.64%	1.49%	5.97%	0.02%	52.67%	1.47%
自基金合同生效起至今	58.80%	1.48%	6.06%	0.02%	52.74%	1.46%

#### 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。

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。

## § 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 6 月 26 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	-	11 年	南开大学经济学学士，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 日至 2014 年 12 月 23 日任大成货币市场证券投资基金基 金经理助理。2014 年 6 月 23 日至 2014 年 12 月 23 日任大成丰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，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。2015 年 3 月 27 日起，任大成景秀灵活配置混合 型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月 29 日起， 任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基 金经

					理。2015 年 5 月 4 日起，任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月 15 日起，任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成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，大成景益平稳收益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些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，第三产业增速提升抵消了二产增速的下滑，其中，金融服务业在三产中的表现尤其突出，同比增速较去年底大幅提升 7.2 个百分点至 17.40%，对 GDP 的贡献也显著增强。从二季度开始，企业生产提速，工业增加值逐月回升，而随着地方政府的资金可得性改善，固定资产投资来自国家预算内资金从 5 月份开始持续发力，基建投资增速在 6 月份也开始出现企稳回升的迹象。今年上半年，虽然地产销售持续改善，但其对投资的传导效应仍不明显，房地产投资继续下滑，目前已经接近历史低位。总体来看，经济整体保持平稳。虽然猪价在二季度上涨明显，但在总需求不足的情况下，并未引起其他商品出现共振，CPI 在低位企稳，PPI 继续负增。

今年上半年，货币政策持续发力，通过 3 次降息、2 次降准、下调 MLF 和公开市场操作利率等多种手段来引导资金利率下行，市场流动性十分充裕，银行间隔夜和 7 天回购利率分别下行 261bp 和 226bp 至 1.15% 和 2.81%，接近历史低位。总体来看，在宽松的流动性和稳定的基本面环境下，债券收益率曲线出现陡峭化下行，期限利差大幅扩大，信用利差不断压缩。

虽然企业盈利仍乏善可陈，但是经济改革和结构化转型出现了一些端倪，在宽松资金面的推动下，上半年权益类资产表现亮眼，股市估值水平不断抬升。

上半年，本基金积极参与权益和债券市场，根据市场行情灵活调整资产结构。

##### 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 1.588 元，本报告期份额净值增长率为 10.66%，同期业绩比较基准增长率为 2.77%，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

从宏观经济基本面看，虽然二季度经济表现超出市场预期，工业增加值、房地产新开工以及基建投资已经出现一些积极的信号，但我们认为基础并不牢固，仍需要等待更多的数据印证。首先，随着股市财富效应的显现，金融业对经济的拉动作用大幅提升，而随着股市进入宽幅震荡期，未来来自金融业的贡献会有所下降。其次，库存周期对二季度的经济增长有贡献，但是供需形势并未见明显改善，体现在产销率指标持续下滑和工业品价格仍在下行通道，看起来前期生产的恢复主要体现在库存的积累上，后续经济可能会面临去库存压力。在这种背景下，未来央行的货币政策大概率仍会维持宽松，债券市场仍然面临有利的基本面环境和流动性宽松格局。随着未来对

股票场外配资行为的规范，股票市场很难再出现上半年那样的单边上涨行情，未来将进入宽幅震荡期。

我们计划提高债券资产比例，根据市场行情对权益资产采取更加灵活的操作策略。

#### 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

本基金管理人将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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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本基金的投资运作、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本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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：大成景益平稳收益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	6.4.2.1	13,352,143.33	140,235,298.48
结算备付金		26,463,500.32	29,990,575.08
存出保证金		659,175.59	283,497.84
交易性金融资产	6.4.2.2	1,423,439,827.97	1,912,739,975.12
其中：股票投资		226,742,771.89	404,526,430.85

基金投资		-	-
债券投资		1,196,697,056.08	1,508,213,544.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		22,799,378.06	10,902,754.69
应收利息	6.4.2.5	22,112,707.73	19,095,153.14
应收股利		-	-
应收申购款		49,701.79	958,155.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		1,508,876,434.79	2,114,205,409.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		269,999,711.40	502,699,984.70
应付证券清算款		-	32,254,849.93
应付赎回款		751,048.48	1,055,062.52
应付管理人报酬		1,011,070.11	942,823.75
应付托管费		315,959.42	294,632.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	1,547,787.40	1,314,054.31
应交税费		-	-
应付利息		49,546.50	72,294.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	180,938.62	160,924.98
负债合计		273,856,061.93	538,794,626.83
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.2.9	777,887,554.13	1,097,696,187.40
未分配利润	6.4.2.10	457,132,818.73	477,714,595.22
所有者权益合计		1,235,020,372.86	1,575,410,782.62
负债和所有者权益总计		1,508,876,434.79	2,114,205,409.45

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.588 元，基金份额总额 777,887,554.13 份。

## 6.2 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：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	上年度可比期间 2014年6月26日(基 金合同生效日)至 2014年6月30日
<b>一、收入</b>		204,698,389.13	550,692.72
1. 利息收入		20,239,320.03	416,655.03
其中：存款利息收入	6.4.2.11	661,581.79	55,670.28
债券利息收入		19,569,113.72	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,624.52	360,984.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		438,325,766.47	-
其中：股票投资收益	6.4.2.12	175,486,122.64	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	260,972,899.63	-
资产支持证券投资收益	6.4.2.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.2.14	-	-
衍生工具收益	6.4.2.15	-	-
股利收益	6.4.2.16	1,866,744.20	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	-255,150,478.86	134,037.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.18	1,283,781.49	-
<b>减：二、费用</b>		19,798,883.34	95,284.41
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	5,990,810.45	61,015.48
2. 托管费	6.4.5.2.2	1,872,128.28	19,067.34
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.19	5,425,644.56	10,918.79
5. 利息支出		6,290,419.59	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,290,419.59	-
6. 其他费用	6.4.2.20	219,880.46	4,282.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		184,899,505.79	455,408.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		184,899,505.79	455,408.31

### 6.3 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：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）	1,097,696,187.40	477,714,595.22	1,575,410,782.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	184,899,505.79	184,899,505.79
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）	-319,808,633.27	-205,481,282.28	-525,289,915.55
其中：1. 基金申购款	107,693,776.06	65,584,553.16	173,278,329.22
2. 基金赎回款	-427,502,409.33	-271,065,835.44	-698,568,244.77
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）	777,887,554.13	457,132,818.73	1,235,020,372.86
项目	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)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）	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（本期利润）	-	455,408.31	455,408.31
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）			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	695,878,758.69	455,408.31	696,334,167.00

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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.2.1 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	13,352,143.33
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	13,352,143.33

##### 6.4.2.2 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	231,316,197.21	226,742,771.89	-4,573,425.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	399,709,056.08	-11,323,667.05
	银行间市场	796,988,000.00	-2,834,810.65
	合计	1,196,697,056.08	-14,158,477.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,442,171,730.99	1,423,439,827.97	-18,731,903.02

##### 6.4.2.3 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。

##### 6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.2.5 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	24,582.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,717.74
应收债券利息	22,077,140.21
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	267.03
合计	22,112,707.73

#### 6.4.2.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.2.7 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	1,536,216.69
银行间市场应付交易费用	11,570.71
合计	1,547,787.40

#### 6.4.2.8 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	2,419.93
应付其他	0.20
预提费用	178,518.49
合计	180,938.62

#### 6.4.2.9 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	1,097,696,187.40	1,097,696,187.40
本期申购	107,693,776.06	107,693,776.06
本期赎回（以“-”号填列）	-427,502,409.33	-427,502,409.33
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	777,887,554.13	777,887,554.13

## 6.4.2.10 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	160,191,744.93	317,522,850.29	477,714,595.22
本期利润	440,049,984.65	-255,150,478.86	184,899,505.79
本期基金份额交易产生的变动数	-129,509,360.58	-75,971,921.70	-205,481,282.28
其中：基金申购款	37,543,216.75	28,041,336.41	65,584,553.16
基金赎回款	-167,052,577.33	-104,013,258.11	-271,065,835.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	470,732,369.00	-13,599,550.27	457,132,818.73

## 6.4.2.11 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	436,249.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	220,940.10
其他	4,391.81
合计	661,581.79

## 6.4.2.12 股票投资收益

## 6.4.2.12.1 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	2,027,785,742.32
减：卖出股票成本总额	1,852,299,619.68
买卖股票差价收入	175,486,122.64

## 6.4.2.13 债券投资收益

## 6.4.2.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

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

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,840,145,362.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,559,224,912.53
减：应收利息总额	19,947,549.86
买卖债券差价收入	260,972,899.63

#### 6.4.2.13.2 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资。

#### 6.4.2.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.2.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.2.16 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	1,866,744.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,866,744.20

#### 6.4.2.17 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	-255,150,478.86
——股票投资	-56,699,750.99
——债券投资	-198,450,727.87
——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	-255,150,478.86

#### 6.4.2.18 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	1,283,781.49
合计	1,283,781.49

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。

#### 6.4.2.19 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	5,418,732.06
银行间市场交易费用	6,912.50
合计	5,425,644.56

#### 6.4.2.20 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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
其他	350.00
上清所债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	23,011.97
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	219,880.46

#### 6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.3.1 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。

##### 6.4.3.2 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。

#### 6.4.4 关联方关系

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.5.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.5.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.5.2 关联方报酬

###### 6.4.5.2.1 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 6 月 26 日 (基金合同 生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,990,810.45	61,015.48
其中：支付销售机构的客户维护费	63,458.47	3,864.96

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。

###### 6.4.5.2.2 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	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日 (基金合同 生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	1,872,128.28	19,067.34
----------------	--------------	-----------

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。

#### 6.4.5.3 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
中国农业银行	31,935,219.86	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 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	9,999,000.00
期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
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	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.29%	1.44%

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。

##### 6.4.5.4.2 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。

## 6.4.5.5 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		上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)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
中国农业银行	13,352,143.33	436,249.88	47,878,708.69	55,670.28

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。

## 6.4.5.6 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。

## 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.6 利润分配情况

## 6.4.6.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

## 6.4.7 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.7.1 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

6.4.7.1.1 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	网下认购 新股暂未流通	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-

## 6.4.7.2 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	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000024	招商地产	2015/4/3	重大事项停牌	36.51	-	-	96	2,450.16	3,504.96	估值价采用指数收益法
300353	东土科技	2015/6/3	重大事项停牌	57.80	-	-	300,000	12,874,367.00	17,340,000.00	估值价采用指



										数收益 法
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------

### 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金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 99,999,730.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140229	14 国开 29	2015 年 7 月 2 日	100.15	1,000,000	100,150,000.00
合计				1,000,000	100,150,000.00

#### 6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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 169,999,981.40 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。

### 6.4.8 金融工具风险及管理

#### 6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

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。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）。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.8.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行农行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.8.2.1 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	40,357,000.00	30,189,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	151,001,000.00	80,095,000.00
合计	191,358,000.00	110,284,000.00

##### 6.4.8.2.2 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	126,258,509.40	714,842,883.85
AAA 以下	464,531,956.18	604,913,145.92
未评级	414,548,590.50	78,173,514.50
合计	1,005,339,056.08	1,397,929,544.27

### 6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 269,999,711.40 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.8.4 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。

#### 6.4.8.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.8.4.1.1 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	13,352,143.33	-	-	-	13,352,143.33
结算备付金	26,463,500.32	-	-	-	26,463,500.32
存出保证金	659,175.59	-	-	-	659,175.59
交易性金融资产	191,358,000.00	475,001,680.50	530,337,375.58	226,742,771.89	1,423,439,827.97
应收证券清算款	-	-	-	22,799,378.06	22,799,378.06
应收利息	-	-	-	22,112,707.73	22,112,707.73
应收申购款	-	-	-	49,701.79	49,701.79
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	231,832,819.24	475,001,680.50	530,337,375.58	271,704,559.47	1,508,876,434.79
负债					
卖出回购金融资产款	269,999,711.40	-	-	-	269,999,711.40
应付赎回款	-	-	-	751,048.48	751,048.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,011,070.11	1,011,070.11
应付托管费	-	-	-	315,959.42	315,959.42
应付交易费用	-	-	-	1,547,787.40	1,547,787.40
应付利息	-	-	-	49,546.50	49,546.50
其他负债	-	-	-	180,938.62	180,938.62
负债总计	269,999,711.40	-	-	3,856,350.53	273,856,061.93
利率敏感度缺口	-38,166,892.16	475,001,680.50	530,337,375.58	267,848,208.94	1,235,020,372.86
上年度末 2014年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	140,235,298.48	-	-	-	140,235,298.48

结算备付金	29,990,575.08	-	-	-	29,990,575.08
存出保证金	283,497.84	-	-	-	283,497.84
交易性金融资产	279,280,639.05	758,843,086.02	470,089,819.20	404,526,430.85	1,912,739,975.12
应收证券清算款	-	-	-	10,902,754.69	10,902,754.69
应收利息	-	-	-	19,095,153.14	19,095,153.14
应收申购款	-	-	-	958,155.10	958,155.10
资产总计	449,790,010.45	758,843,086.02	470,089,819.20	435,482,493.78	2,114,205,409.45
负债					
卖出回购金融资产款	502,699,984.70	-	-	-	502,699,984.70
应付证券清算款	-	-	-	32,254,849.93	32,254,849.93
应付赎回款	-	-	-	1,055,062.52	1,055,062.52
应付管理人报酬	-	-	-	942,823.75	942,823.75
应付托管费	-	-	-	294,632.42	294,632.42
应付交易费用	-	-	-	1,314,054.31	1,314,054.31
应付利息	-	-	-	72,294.22	72,294.22
其他负债	-	-	-	160,924.98	160,924.98
负债总计	502,699,984.70	-	-	36,094,642.13	538,794,626.83
利率敏感度缺口	-52,909,974.25	758,843,086.02	470,089,819.20	399,387,851.65	1,575,410,782.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.8.4.1.2 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）
	市场利率下降 25 个基点	8,247,613.00	3,429,950.00
市场利率上升 25 个基点	-8,058,021.00	-3,240,776.00	

#### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.4.3 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为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。

##### 6.4.8.4.3.1 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	226,742,771.89	18.36	404,526,430.85	25.68
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	226,742,771.89	18.36	404,526,430.85	25.68

##### 6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 18.36%，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。

#### 6.4.9 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	226,742,771.89	15.03
	其中：股票	226,742,771.89	15.03
2	固定收益投资	1,196,697,056.08	79.31
	其中：债券	1,196,697,056.08	79.31
	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	39,815,643.65	2.64
7	其他各项资产	45,620,963.17	3.02
8	合计	1,508,876,434.79	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	0.04
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	71,149,160.44	5.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	28,080,000.00	2.27
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,271,087.78	4.23
J	金融业	248,328.18	0.02
K	房地产业	51,629,455.84	4.18
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	22,880,460.00	1.85
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	226,742,771.89	18.36

## 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	002285	世联行	1,850,672	39,678,407.68	3.21
2	600050	中国联通	4,575,000	33,534,750.00	2.72
3	601006	大秦铁路	2,000,000	28,080,000.00	2.27
4	002651	利君股份	550,018	23,760,777.60	1.92
5	000802	北京文化	786,000	22,880,460.00	1.85
6	002465	海格通信	554,990	17,865,128.10	1.45
7	300353	东土科技	300,000	17,340,000.00	1.40
8	600476	湘邮科技	389,950	14,744,009.50	1.19
9	600325	华发股份	660,000	11,946,000.00	0.97
10	300207	欣旺达	399,922	9,686,110.84	0.78
11	300036	超图软件	100,323	3,679,847.64	0.30
12	002766	索菱股份	25,350	862,153.50	0.07
13	002760	凤形股份	22,488	813,615.84	0.07
14	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.04
15	002773	康弘药业	17,444	413,946.12	0.03
16	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.02
17	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.02
18	300481	N 惠成	11,296	148,542.40	0.01
19	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.01
20	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.01
21	002771	真视通	500	10,120.00	0.00
22	601318	中国平安	97	7,948.18	0.00
23	000024	招商地产	96	3,504.96	0.00
24	600376	首开股份	80	1,543.20	0.00
25	002450	康得新	35	1,071.00	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	600875	东方电气	161,724,993.66	10.27
2	601318	中国平安	108,371,840.17	6.88
3	600219	南山铝业	87,541,556.16	5.56
4	600050	中国联通	65,415,835.79	4.15



5	601688	XD 华泰证	52,813,820.01	3.35
6	000001	平安银行	50,549,497.00	3.21
7	000800	一汽轿车	50,091,741.37	3.18
8	600446	金证股份	43,156,982.76	2.74
9	002285	世联行	41,596,553.30	2.64
10	002230	科大讯飞	36,784,538.98	2.33
11	601628	中国人寿	35,741,075.59	2.27
12	600795	国电电力	33,951,540.67	2.16
13	000802	北京文化	31,387,006.57	1.99
14	002651	利君股份	30,280,235.36	1.92
15	002465	海格通信	30,261,840.50	1.92
16	600067	冠城大通	29,726,609.30	1.89
17	601989	中国重工	29,517,413.00	1.87
18	600325	华发股份	28,953,806.07	1.84
19	002450	康得新	28,287,377.93	1.80
20	601006	大秦铁路	27,577,626.00	1.75

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	600875	东方电气	167,048,354.40	10.60
2	601318	中国平安	102,790,425.12	6.52
3	600219	南山铝业	91,474,969.35	5.81
4	601688	XD 华泰证	85,713,472.34	5.44
5	600036	招商银行	77,922,016.66	4.95
6	600446	金证股份	55,838,051.74	3.54
7	000800	一汽轿车	52,625,075.10	3.34
8	000001	平安银行	51,231,586.84	3.25
9	002465	海格通信	49,926,726.13	3.17
10	002230	科大讯飞	48,645,190.95	3.09
11	601166	兴业银行	44,595,723.05	2.83
12	600185	格力地产	44,216,952.09	2.81
13	601628	中国人寿	37,805,520.83	2.40
14	600795	国电电力	34,566,562.87	2.19
15	600050	中国联通	32,266,630.78	2.05
16	600376	首开股份	31,819,490.24	2.02

17	000958	东方能源	31,210,617.00	1.98
18	002450	康得新	30,654,500.16	1.95
19	002544	杰赛科技	29,936,831.61	1.90
20	601336	新华保险	29,694,266.42	1.88

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	1,731,215,711.71
卖出股票收入（成交）总额	2,027,785,742.32

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	740,590.50	0.06
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	504,317,000.00	40.83
	其中：政策性金融债	504,317,000.00	40.83
4	企业债券	358,491,358.10	29.03
5	企业短期融资券	100,849,000.00	8.17
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	232,299,107.48	18.81
8	其他	-	0.00
9	合计	1,196,697,056.08	96.90

#### 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	150203	15 国开 03	1,800,000	179,046,000.00	14.50
2	140229	14 国开 29	1,300,000	130,195,000.00	10.54
3	113501	洛钼转债	833,930	116,283,199.20	9.42
4	128009	歌尔转债	491,656	78,065,139.68	6.32
5	011599073	15 中城建 SCP001	600,000	60,492,000.00	4.90

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无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。**

**7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。**

**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	659,175.59
2	应收证券清算款	22,799,378.06
3	应收股利	-
4	应收利息	22,112,707.73
5	应收申购款	49,701.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,620,963.17

## 7.12.4 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	113501	洛钼转债	116,283,199.20	9.42
2	128009	歌尔转债	78,065,139.68	6.32
3	110030	格力转债	34,587,242.60	2.80
4	113007	吉视转债	2,952,298.70	0.24

## 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	17,340,000.00	1.40	重大事项停牌

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
656	1,185,804.20	759,488,237.89	97.63%	18,399,316.24	2.37%

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	1,866,370.90	0.24%

## 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	50~100
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	1,097,696,187.40
本报告期基金总申购份额	107,693,776.06
减：本报告期基金总赎回份额	427,502,409.33
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	777,887,554.13

## § 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

无。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 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	1	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	361,582,045.37	10.82%	329,182.30	10.94%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	2	60,125,585.40	1.80%	54,738.58	1.82%	-
东兴证券	1	50,297,323.48	1.50%	44,508.04	1.48%	-
方正证券	1	86,801,306.53	2.60%	79,024.20	2.63%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	75,047,681.96	2.25%	68,323.54	2.27%	-
国金证券	2	203,299,249.93	6.08%	180,867.57	6.01%	-
国盛证券	1	5,381,000.00	0.16%	4,761.68	0.16%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	408,364,942.67	12.22%	371,774.54	12.35%	-
海通证券	1	702,280,425.89	21.01%	621,453.72	20.65%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	21,604,247.57	0.65%	19,117.72	0.64%	-
华泰联合	1	29,733,810.82	0.89%	26,311.96	0.87%	-
民生证券	1	90,459,206.32	2.71%	82,353.55	2.74%	-

南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	20,918,819.30	0.63%	19,044.43	0.63%	-
齐鲁证券	1	57,494,917.51	1.72%	52,343.62	1.74%	-
瑞银证券	1	464,676,200.63	13.90%	423,040.27	14.06%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	187,548,457.10	5.61%	170,743.88	5.67%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	4	157,024,887.44	4.70%	141,448.93	4.70%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	59,124,200.50	1.77%	52,319.11	1.74%	-
浙商证券	1	178,662,524.55	5.35%	158,101.04	5.25%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	32,229,636.70	0.96%	28,520.27	0.95%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	89,919,019.22	2.69%	81,862.81	2.72%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

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

本报告期内本基金退租的交易单元：中信建投 1 个交易单元，新增交易单元：第一创业、山西证券各 1 个交易单元。

## 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	-	0.00%	270,000,000.00	1.05%	-	0.00%
北京高华	385,111,019.10	21.96%	7,364,300,000.00	28.54%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	820,000,000.00	3.18%	-	0.00%
东兴证券	33,418,954.42	1.91%	125,000,000.00	0.48%	-	0.00%
方正证券	165,562,191.98	9.44%	530,300,000.00	2.05%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	279,700,000.00	1.08%	-	0.00%
国金证券	27,836,536.12	1.59%	464,000,000.00	1.80%	-	0.00%
国盛证券	38,754,486.73	2.21%	10,000,000.00	0.04%	-	0.00%
国信证券	214,586,877.50	12.23%	3,388,000,000.00	13.13%	-	0.00%
海通证券	58,536,928.55	3.34%	555,000,000.00	2.15%	-	0.00%
华泰联合	-	0.00%	13,000,000.00	0.05%	-	0.00%
民生证券	98,561,132.60	5.62%	1,145,000,000.00	4.44%	-	0.00%
平安证券	3,290,000.00	0.19%	150,000,000.00	0.58%	-	0.00%
齐鲁证券	5,982,030.80	0.34%	557,000,000.00	2.16%	-	0.00%
瑞银证券	188,642,930.62	10.76%	6,326,300,000.00	24.51%	-	0.00%
上海证券	132,449,193.30	7.55%	2,741,700,000.00	10.62%	-	0.00%
银河证券	72,357,707.63	4.13%	660,000,000.00	2.56%	-	0.00%
招商证券	228,756,972.36	13.04%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	15,937,349.05	0.91%	98,000,000.00	0.38%	-	0.00%
中信建投	4,472,351.77	0.25%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	79,690,325.00	4.54%	310,000,000.00	1.20%	-	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	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加张家港农商行为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/9
2	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
3	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
4	大成景益平稳收益混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21



5	关于大成景益平稳收益混合型证券投资基金增加和讯科技为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	大成景益平稳收益混合型证券投资基金更新招募说明书(2014 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/10
14	大成景益平稳收益混合型证券投资基金更新招募说明书摘要(2014 年 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/10
15	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
16	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	2015/3/4
17	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
18	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
19	大成景益平稳收益混合型证券投资基金 2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
20	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
21	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
22	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
23	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
24	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/10
25	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
26	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

27	大成景益平稳收益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
28	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
29	大成基金管理有限公司关于调整网上直销通联支付交易费率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
30	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
31	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
32	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
33	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
34	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“超图软件”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/9
35	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
36	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益平稳收益混合型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景益平稳收益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