

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成 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	3,741,509,957.00 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、个券投资价值评价体系，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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管业务部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	2,106,432,893.21	281,495,670.36	82,207,053.54
本期利润	1,936,596,960.06	53,004,856.11	238,942,454.72
加权平均基金份额本期利润	0.3643	0.0055	0.0210
本期基金份额净值增长率	29.97%	2.22%	2.94%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1630	-0.3559	-0.3826
期末基金资产净值	3,131,588,329.47	5,335,271,175.18	6,614,086,105.93

期末基金份额净值	0.837	0.644	0.630
----------	-------	-------	-------

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。

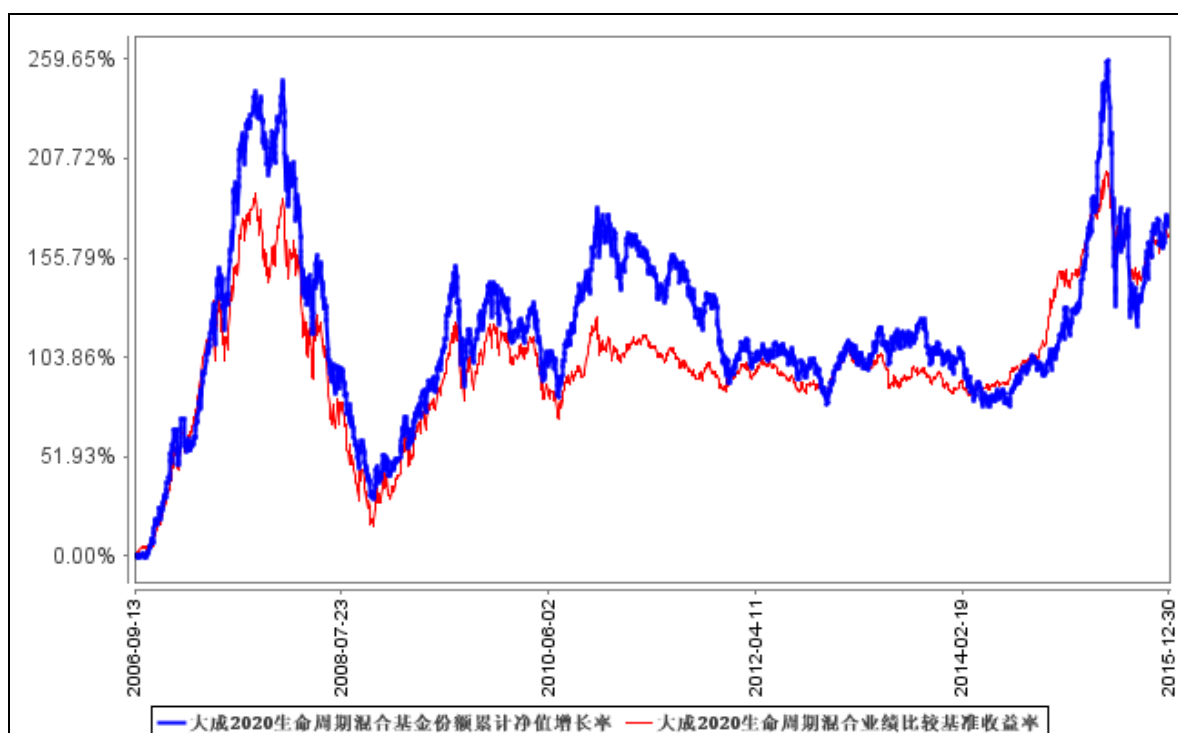
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	16.74%	1.54%	9.16%	0.75%	7.58%	0.79%
过去六个月	-4.78%	2.22%	-4.11%	1.20%	-0.67%	1.02%
过去一年	29.97%	2.01%	8.97%	1.12%	21.00%	0.89%
过去三年	36.76%	1.42%	34.27%	0.81%	2.49%	0.61%
过去五年	1.58%	1.27%	28.71%	0.72%	-27.13%	0.55%
自基金合同生效起至今	172.97%	1.58%	166.78%	1.28%	6.19%	0.30%

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

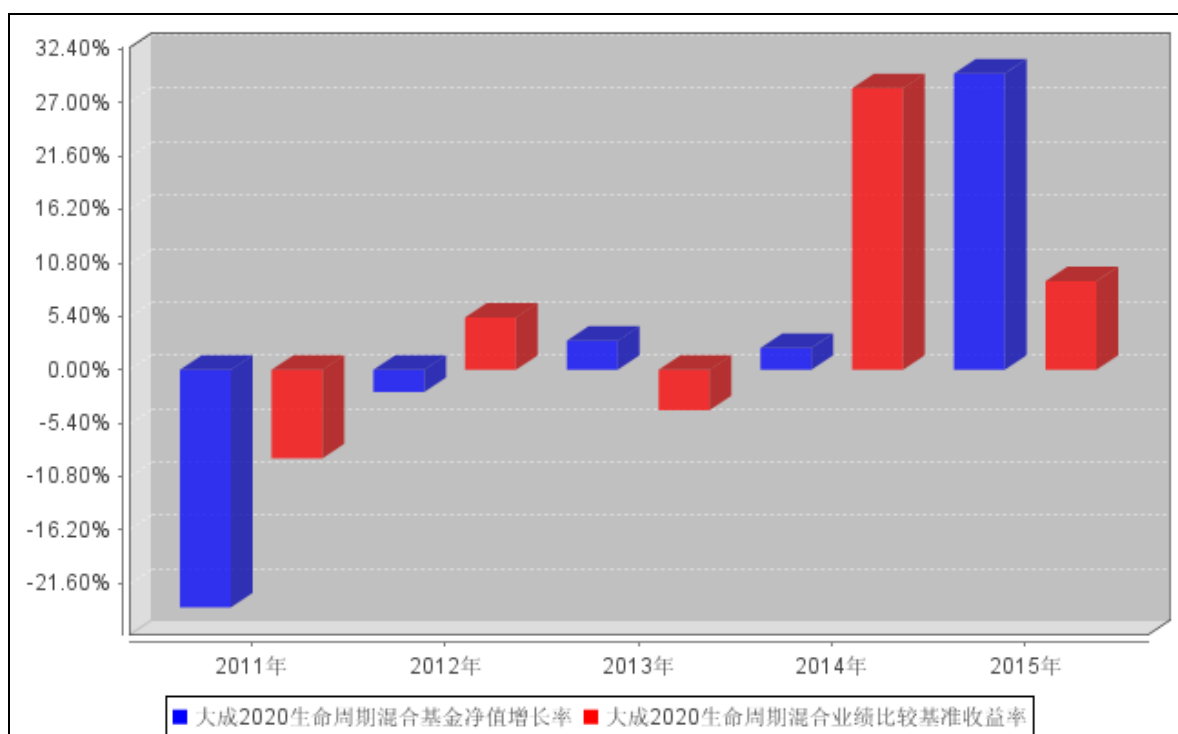


注：1. 自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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%

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

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 12 月 31 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 55 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、大成景源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、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

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	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		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。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
魏庆国先生	本基金基金经理	2014年10月28日	2015年3月30日	6年	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。
侯春女士	本基金基金经理助理	2015年4月1日	-	6年	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4月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

					资基金基金经理助理。2013 年 3 月 11 日至 2015 年 4 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 4 月 1 日起担任大成财富管理 2020 基金经理助理。2015 年 12 月 9 日起担任大成蓝筹稳健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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于于

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，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 130 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的仅有 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，注定是中国证券史上值得浓墨重写的一年。在这一年，宏观经济趋弱，尽管保增长不断，但也基本在市场预期内。因此影响市场大幅波动的核心因素变为无风险利率和风险偏好。全年来看，货币政策呈现持续偏松格局，使得市场流动性较为充裕，无风险利率处于较低水平且有下降预期；而无风险偏好持续提升，加上金融的持续加杠杆，在 6 月份之前出现了罕见的牛市泡沫。在市场有其内在调整需求的背景下，政策对融资杠杆的处理过于生硬，导致市场出现罕见的股灾。在第四季度，监管政策对市场的不断呵护，叠加经过股灾后的部分股票估值趋于合理，市场出现明显的反弹。正如我们在半年报、第三季报的判断，A 股走出了股灾。

2015 年，我们主要围绕农业互联网、国企改革、先进制造业、文化娱乐等行业做了布局，且对不少个股做了波段，盈利的主要贡献来自于重仓个股，同时鉴于对 2016 年市场震荡的格局的判断和本基金产品对仓位调整至 50% 的契约规定，在 12 月份，我们对股票仓位做了大幅度的减仓。

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 0.837 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.97% 同期业绩比较基准收益率为 8.97%，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 2016 年，全球视野看，预计是比 2015 年更为困难的一年。从宏观经济来看，国内经济难有起色，保增长不再，尽管我们寄希望于供给侧改革能给中长期的经济增长打好基础，但当前阶段，我们不得不面临改革的巨大代价；另外，从流动性的角度看，存在内交外困的局面，具体

而言，美元的走强和人民币的走弱在中长期都将是一种趋势，尽管外汇干预政策主旨是人民币贬值可控，但人民币贬值预期将始终压制市场。从内部而言，出现了一个非常大的变化，从新年最高当局的表态来看，宽松的货币环境似乎不会再出现，至多是稳健的货币政策，这在边际上是很大的变化。

从股市的供求情况看，鉴于去年下半年以来不断累高的减持堰塞湖，目前仍无非常好的处理办法。加上一二级市场、一级半市场对注册制加快的预期和监管对并购重组的积极鼓励，预计再融资的增量会在上半年形成一个高潮，股票供给又会大比例增加。加上 IPO 也将加大供给。供求失衡的局面会阶段性出现。

因此，我们预计 2016 年的股票市场将难有好的表现，但结构性、阶段性机会是存在的。2016 年度机会是阶段性、局部性的，围绕这两点，我们的打法将是精选行业个股、波段操作。另外由于本基金的固定收益仓位大幅提高，我们也将在这个领域做出更大的努力。

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 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,091,788,970.01	276,943,706.73
结算备付金	10,041,761.19	7,587,202.76
存出保证金	1,426,467.17	1,562,151.00
交易性金融资产	1,806,269,875.39	5,016,811,126.09
其中：股票投资	1,509,836,155.39	3,631,488,388.19
基金投资	-	-
债券投资	296,433,720.00	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	229,800,614.70	471,222,066.83
应收证券清算款	28,386,272.87	113,933,361.51
应收利息	5,018,626.19	13,147,108.09
应收股利	-	-
应收申购款	65,069.95	48,083.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,172,797,657.47	5,901,254,806.04
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	480,000,000.00
应付证券清算款	30,045,471.21	63,471,893.23
应付赎回款	1,389,481.40	6,874,644.15
应付管理人报酬	3,692,147.93	6,354,503.13
应付托管费	659,312.11	1,134,732.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,879,829.53	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	508,162.62	730,577.48
负债合计	41,209,328.00	565,983,630.86
所有者权益：		
实收基金	3,741,509,957.00	8,283,184,510.94
未分配利润	-609,921,627.53	-2,947,913,335.76
所有者权益合计	3,131,588,329.47	5,335,271,175.18
负债和所有者权益总计	3,172,797,657.47	5,901,254,806.04

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.837 元，基金份额总额 3,741,509,957.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	2,059,069,651.30	186,633,245.56
1. 利息收入	32,246,781.06	48,146,611.80
其中：存款利息收入	4,748,347.45	5,308,160.96
债券利息收入	24,067,596.06	35,972,276.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,430,837.55	6,866,173.99
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,193,446,522.39	365,962,378.37
其中：股票投资收益	1,974,856,037.37	264,557,463.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	204,940,287.65	67,317,791.52
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	13,650,197.37	34,087,123.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-169,835,933.15	-228,490,814.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,212,281.00	1,015,069.64
减：二、费用	122,472,691.24	133,628,389.45
1. 管理人报酬	59,331,329.30	80,225,504.15
2. 托管费	10,594,880.25	14,325,982.88

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	50,969,368.68	37,375,711.70
5. 利息支出	1,003,366.37	1,097,099.57
其中：卖出回购金融资产支出	1,003,366.37	1,097,099.57
6. 其他费用	573,746.64	604,091.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,936,596,960.06	53,004,856.11
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,936,596,960.06	53,004,856.11

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	1,936,596,960.06	1,936,596,960.06
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）	-4,541,674,553.94	401,394,748.17	-4,140,279,805.77
其中：1. 基金申购款	179,951,294.19	-26,661,622.41	153,289,671.78
2. 基金赎回款	-4,721,625,848.13	428,056,370.58	-4,293,569,477.55
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）	3,741,509,957.00	-609,921,627.53	3,131,588,329.47
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	10,497,945,519.47	-3,883,859,413.54	6,614,086,105.93

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,004,856.11	53,004,856.11
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)	-2,214,761,008.53	882,941,221.67	-1,331,819,786.86
其中:1.基金申购款	49,059,030.09	-19,801,625.02	29,257,405.07
2.基金赎回款	-2,263,820,038.62	902,742,846.69	-1,361,077,191.93
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)	8,283,184,510.94	-2,947,913,335.76	5,335,271,175.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 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相一致。

7.4.1.2 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、可交换债券、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。

7.4.1.3 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》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	854,386,563.46	2.65%	1,599,226,004.36	6.55%

7.4.3.1.2 债券交易

无。

7.4.3.1.3 债券回购交易

无。

7.4.3.1.4 权证交易

无。

7.4.3.1.5 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	770,232.73	2.64%	73,110.44	1.50%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	1,426,773.38	6.52%	372,967.05	5.08%

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

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

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	59,331,329.30
其中：支付销售机构的客户维护费	8,785,212.41	11,859,110.99

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。

7.4.3.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,594,880.25	14,325,982.88

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。

7.4.3.3 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 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	989,800,000.00	573,037.80
上年度可比期间						
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	30,962,129.59	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	1,091,788,970.01	4,471,690.39	276,943,706.73	5,147,838.18

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.4 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 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
600565	迪马股份	2015年12月30日	重大事项	11.68	2016年1月7日	11.03	9,518,559	134,803,852.56	111,176,769.12	-
601058	赛轮金宇	2015年12月28日	重大事项	9.00	2016年1月12日	8.10	6,513,790	48,747,074.63	58,624,110.00	-
600282	南钢股份	2015年12月30日	重大事项	3.17	2016年1月12日	3.24	13,790,292	48,510,787.29	43,715,225.64	-

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，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。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,509,836,155.39	47.59
	其中：股票	1,509,836,155.39	47.59
2	固定收益投资	296,433,720.00	9.34
	其中：债券	296,433,720.00	9.34
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	229,800,614.70	7.24
	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	1,101,830,731.20	34.73
7	其他各项资产	34,896,436.18	1.10
8	合计	3,172,797,657.47	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	219,794,994.90	7.02
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	803,154,542.09	25.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,442,729.49	1.10
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	1,579,507.00	0.05
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	562,851.12	0.02
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	111,176,769.12	3.55
L	租赁和商务服务业	153,660,334.04	4.91
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	143,930,586.59	4.60
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	41,533,841.04	1.33

S	综合	-	0.00
	合计	1,509,836,155.39	48.21

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	启迪桑德	3,462,931	137,201,326.22	4.38
2	600887	伊利股份	8,129,527	133,568,128.61	4.27
3	002449	国星光电	7,825,250	132,246,725.00	4.22
4	600565	迪马股份	9,518,559	111,176,769.12	3.55
5	600108	亚盛集团	13,099,965	96,153,743.10	3.07
6	600415	小商品城	9,923,952	91,201,118.88	2.91
7	002507	涪陵榨菜	3,835,503	71,992,391.31	2.30
8	601118	海南橡胶	9,355,380	70,726,672.80	2.26
9	000061	农产品	3,530,764	62,459,215.16	1.99
10	601058	赛轮金宇	6,513,790	58,624,110.00	1.87

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002614	蒙发利	645,232,904.94	12.09
2	601318	中国平安	576,933,496.81	10.81
3	000002	万科A	576,762,322.81	10.81
4	600565	迪马股份	450,851,655.35	8.45
5	000061	农产品	434,092,565.06	8.14
6	600713	南京医药	428,700,955.53	8.04
7	600887	伊利股份	423,430,402.42	7.94
8	300027	华谊兄弟	400,990,697.72	7.52
9	000826	启迪桑德	378,435,547.51	7.09

10	600655	豫园商城	307,759,746.16	5.77
11	600016	民生银行	306,819,788.73	5.75
12	600872	中炬高新	274,068,239.24	5.14
13	600219	南山铝业	245,015,926.83	4.59
14	600535	天士力	238,033,704.19	4.46
15	600739	辽宁成大	223,330,225.87	4.19
16	601258	庞大集团	220,341,809.37	4.13
17	601058	赛轮金宇	198,664,805.28	3.72
18	000685	中山公用	176,372,856.47	3.31
19	000338	潍柴动力	165,186,705.49	3.10
20	600699	均胜电子	160,484,290.32	3.01
21	600048	保利地产	154,834,587.66	2.90
22	601166	兴业银行	147,894,598.69	2.77
23	600668	尖峰集团	138,258,317.21	2.59
24	300273	和佳股份	133,571,622.81	2.50
25	000816	智慧农业	132,192,698.80	2.48
26	601899	紫金矿业	130,397,674.63	2.44
27	600382	广东明珠	129,627,881.74	2.43
28	600257	大湖股份	128,775,446.44	2.41
29	600418	江淮汽车	128,737,907.34	2.41
30	002449	国星光电	123,897,373.06	2.32
31	600383	金地集团	123,548,162.69	2.32
32	600415	小商品城	120,927,426.10	2.27
33	600108	亚盛集团	119,882,408.46	2.25
34	002223	鱼跃医疗	118,485,808.14	2.22
35	600039	四川路桥	116,793,841.92	2.19
36	600089	特变电工	115,450,018.63	2.16
37	000423	东阿阿胶	113,718,856.98	2.13
38	000503	海虹控股	107,793,617.45	2.02

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。

8.4.2 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	002614	蒙发利	790,804,021.82	14.82
2	000816	智慧农业	703,652,297.31	13.19
3	600016	民生银行	679,572,462.02	12.74
4	600535	天士力	638,592,216.46	11.97
5	601318	中国平安	636,515,821.09	11.93
6	000002	万科A	625,362,130.28	11.72
7	300027	华谊兄弟	559,884,921.46	10.49
8	600872	中炬高新	483,840,388.48	9.07
9	000848	承德露露	451,293,679.76	8.46
10	002241	歌尔声学	438,763,429.99	8.22
11	600055	华润万东	411,849,058.32	7.72
12	000061	农产品	370,923,827.59	6.95
13	600713	南京医药	366,407,114.52	6.87
14	000826	启迪桑德	364,472,919.10	6.83
15	600887	伊利股份	356,020,245.02	6.67
16	600655	豫园商城	309,308,413.28	5.80
17	000988	华工科技	308,196,720.71	5.78
18	600565	迪马股份	284,322,739.08	5.33
19	600739	辽宁成大	279,617,011.09	5.24
20	000963	华东医药	275,689,929.45	5.17
21	601258	庞大集团	252,542,539.25	4.73
22	002230	科大讯飞	239,330,081.61	4.49
23	600219	南山铝业	236,637,528.58	4.44
24	600699	均胜电子	233,163,010.36	4.37
25	601166	兴业银行	220,241,322.89	4.13
26	600585	海螺水泥	209,392,971.27	3.92
27	000685	中山公用	194,611,901.37	3.65
28	002223	鱼跃医疗	167,286,155.02	3.14
29	000338	潍柴动力	161,929,706.02	3.04
30	601058	赛轮金宇	159,769,887.44	2.99
31	600383	金地集团	153,932,408.88	2.89
32	600418	江淮汽车	149,366,291.82	2.80
33	600257	大湖股份	144,080,588.47	2.70
34	600048	保利地产	141,964,041.51	2.66
35	000423	东阿阿胶	139,428,112.16	2.61
36	002065	东华软件	138,583,285.84	2.60
37	600668	尖峰集团	137,981,513.58	2.59
38	300124	汇川技术	135,989,140.01	2.55

39	000019	深深宝 A	128,985,947.16	2.42
40	000069	华侨城 A	126,340,722.15	2.37
41	600557	康缘药业	125,953,351.47	2.36
42	600382	广东明珠	125,917,131.67	2.36
43	600039	四川路桥	125,304,043.04	2.35
44	601899	紫金矿业	124,985,172.46	2.34
45	600525	长园集团	124,806,583.78	2.34
46	000402	金融街	122,422,903.39	2.29
47	300058	蓝色光标	121,872,838.10	2.28
48	000967	上风高科	116,154,513.04	2.18
49	000503	海虹控股	113,979,824.34	2.14
50	600089	特变电工	113,633,886.15	2.13

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,287,464,793.39
卖出股票收入（成交）总额	18,390,142,865.79

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,650,000.00	1.62
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	219,857,000.00	7.02
	其中：政策性金融债	219,857,000.00	7.02
4	企业债券	5,371,500.00	0.17
5	企业短期融资券	20,184,000.00	0.64
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	371,220.00	0.01
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	296,433,720.00	9.47

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	150208	15 国开 08	900,000	94,401,000.00	3.01
2	150220	15 国开 20	500,000	51,240,000.00	1.64
3	150026	15 付息国债 26	500,000	50,650,000.00	1.62
4	150218	15 国开 18	400,000	42,008,000.00	1.34
5	140229	14 国开 29	300,000	32,208,000.00	1.03

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,426,467.17
2	应收证券清算款	28,386,272.87
3	应收股利	-
4	应收利息	5,018,626.19
5	应收申购款	65,069.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,896,436.18

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600565	迪马股份	111,176,769.12	3.55	重大事项
2	601058	赛轮金宇	58,624,110.00	1.87	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
203,680	18,369.55	2,989,491.82	0.08%	3,738,520,465.18	99.92%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	128,809.16	0.0034%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	179,951,294.19
减：本报告期基金总赎回份额	4,721,625,848.13
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	3,741,509,957.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

1、基金管理人于 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。

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 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十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本会计期间支付的审计费用为 15.50 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			例			
安信证券	2	4,353,448,079.32	13.51%	3,889,245.27	13.35%	-
东海证券	1	3,213,533,690.28	9.97%	2,925,591.96	10.04%	-
海通证券	2	3,056,155,520.22	9.48%	2,791,066.21	9.58%	-
东方证券	1	2,348,229,880.02	7.29%	2,175,512.00	7.47%	-
国信证券	1	2,192,565,694.28	6.80%	1,952,926.40	6.70%	-
招商证券	2	2,120,982,527.01	6.58%	1,889,603.43	6.49%	-
广发证券	1	1,907,779,145.84	5.92%	1,744,304.10	5.99%	-
中投证券	3	1,426,357,014.15	4.43%	1,315,431.04	4.51%	-
申银万国	1	1,325,507,943.11	4.11%	1,172,950.72	4.03%	-
长江证券	1	1,308,739,534.01	4.06%	1,202,317.47	4.13%	-
中信证券	2	1,038,910,744.77	3.22%	952,117.62	3.27%	-
长城证券	1	966,647,347.22	3.00%	856,828.59	2.94%	-
民族证券	1	944,998,953.85	2.93%	836,232.18	2.87%	-
光大证券	2	854,386,563.46	2.65%	770,232.73	2.64%	-
国泰君安	1	785,658,391.17	2.44%	695,236.09	2.39%	-
中金公司	2	783,125,521.55	2.43%	705,229.66	2.42%	-
民生证券	1	638,539,776.77	1.98%	565,041.83	1.94%	-
华泰证券	2	626,008,360.82	1.94%	564,069.97	1.94%	-
国都证券	1	506,021,765.44	1.57%	459,395.80	1.58%	-
财富证券	1	397,262,749.84	1.23%	362,027.58	1.24%	-
西南证券	1	340,262,984.49	1.06%	316,885.09	1.09%	-
万联证券	1	339,517,451.15	1.05%	309,408.31	1.06%	-
国海证券	1	238,601,791.70	0.74%	211,923.25	0.73%	-
银河证券	1	194,626,660.48	0.60%	177,188.58	0.61%	-
华鑫证券	1	151,584,912.63	0.47%	138,002.92	0.47%	-
英大证券	1	109,474,849.34	0.34%	99,767.22	0.34%	-
东莞证券	1	63,276,379.23	0.20%	57,664.36	0.20%	-
天源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华福证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
渤海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

中泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华林证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广州证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	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、报告期内租用交易单元变更情况，新增席位：长城证券。退租交易单元：万和证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		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	22.41%	80,000,000.00	10.81%	-	0.00%
海通证券	585,857,061.90	41.20%	30,000,000.00	4.05%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	23,747,387.24	1.67%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	428,550,554.50	30.14%	300,000,000.00	40.54%	-	0.00%
中投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	65,024,614.44	4.57%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	330,000,000.00	44.59%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民族证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财富证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华鑫证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华福证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华林证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

大成基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日