大成景恒保本混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年8月27日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成景恒保本混合
基金主代码	090019
交易代码	090019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15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	4,600,745,140.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整,修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上,积极参与分享市场可能出现的风险收益,从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。

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		4008888558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	212,078,752.89
本期利润	201,395,551.84
加权平均基金份额本期利润	0.0827
本期基金份额净值增长率	5.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2388
期末基金资产净值	4,600,626,060.44
期末基金份额净值	1.000

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

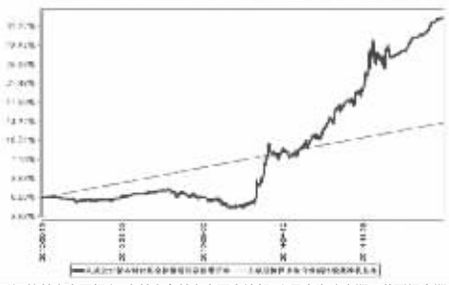
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.57%	0.05%	0.34%	0.01%	0.23%	0.04%
过去三个月	3.53%	0.06%	1.01%	0.01%	2.52%	0.05%
过去六个月	5.32%	0.29%	2.04%	0.01%	3.28%	0.28%
过去一年	20.38%	0.41%	4.23%	0.01%	16.15%	0.40%
过去三年	33.73%	0.31%	13.91%	0.01%	19.82%	0.30%
自基金合同生效起至今	33.86%	0.31%	14.12%	0.01%	19.74%	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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

§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ODII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	2013年7月17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日期间任大成强化收益债券型证券投基金基金经理,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
黄海峰先生	本基金基金经理助理	2013年10月28日	-	10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3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14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,任大成景鹏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遵规守信情况的说明

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》、《大成景恒保本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,大成景恒保本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,本基金积极参与打新,力争为持有人获得相对稳定的尽可能高的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.000元,本报告期份额净值增长率为5.32%,同期业绩比较基准增长率为2.04%,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。

因股市出现大幅波动,证监会暂停了新股发行,本基金计划增持债券资产,在严格控制组合波动性的情况下适当参与权益资产的波段交易机会。

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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在大成景恒保本混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成景恒保本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	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	1,725,112,946.44	18,214,734.63
结算备付金	-	571,897.14
存出保证金	145,090.74	99,382.50
交易性金融资产	1,273,784,375.51	353,872,349.51
其中:股票投资	39,197,375.51	124,565,917.71
基金投资	-	-
债券投资	1,234,587,000.00	229,306,431.80
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	1,599,524,939.30	-
应收证券清算款	-	3,645,663.54
应收利息	8,339,981.18	5,799,532.10
应收股利	-	-
应收申购款	-	67,217.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,606,907,333.17	382,270,777.08
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30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	-	-
应付证券清算款	-	7,829,457.78
应付赎回款	-	283,707.14
应付管理人报酬	4,610,189.09	391,831.79
应付托管费	768,364.84	65,305.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	430,988.11	486,409.66
应交税费	188,252.80	188,252.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	283,477.89	372,928.95
负债合计	6,281,272.73	9,617,893.40
所有者权益:		
实收基金	3,436,673,855.20	293,139,885.73
未分配利润	1,163,952,205.24	79,512,997.95
所有者权益合计	4,600,626,060.44	372,652,883.68
负债和所有者权益总计	4,606,907,333.17	382,270,777.08

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额4,600,745,140.38份。

6.2 利润表

会计主体:大成景恒保本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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	223,979,220.96	73,748,666.89
1.利息收入	33,981,940.00	10,207,512.12
其中:存款利息收入	15,872,860.45	1,176,056.48
债券利息收入	6,446,735.66	8,397,474.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,662,343.89	633,981.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	198,765,250.63	54,328,276.54
其中:股票投资收益	195,257,290.64	49,708,287.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,357,045.18	4,031,475.97
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	150,914.81	588,513.03
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-10,683,201.05	7,891,903.83
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,915,231.38	1,320,974.40
减:二、费用	22,583,669.12	5,123,901.78
1. 管理人报酬	18,263,498.53	3,166,043.34
2. 托管费	3,043,916.40	527,673.88
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,038,531.06	1,212,274.59
5. 利息支出	6,536.72	-
其中:卖出回购金融资产支出	6,536.72	-
6. 其他费用	231,186.41	217,909.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	201,395,551.84	68,624,765.11
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	201,395,551.84	68,624,765.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成景恒保本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)	293,139,885.73	79,512,997.95	372,652,883.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	201,395,551.84	201,395,551.84
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)	3,143,533,969.47	883,043,655.45	4,026,577,624.92
其中:1.基金申购款	3,562,907,139.35	1,014,098,705.61	4,577,005,844.96
2.基金赎回款	-419,373,169.88	-131,055,050.16	-550,428,220.04
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)	3,436,673,855.20	1,163,952,205.24	4,600,626,060.44
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	589,848,006.05	-7,226,980.95	582,621,025.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,624,765.11	68,624,765.11
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)	-178,395,973.48	-15,410,933.49	-193,806,906.97
其中:1.基金申购款	109,224,778.07	4,854,730.06	114,079,508.12
2.基金赎回款	-287,620,751.55	-20,265,663.54	-307,886,415.09
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)	411,452,032.57	45,986,850.67	457,438,883.24

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 肖剑 范瑛

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	261,794,255.31	46.06%	7,280,817.00	0.94%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	27,404,313.90	100.00%	-	0.00%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	185,000,000.00	100.00%	-	0.00%

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	238,338.52	46.77%	103,668.26	27.65%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	6,443.16	0.93%	6,443.16	2.38%

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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,263,498.53	3,166,043.34
其中:支付销售机构的客户维护费	1,076,076.88	1,277,713.61

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.20%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内, 本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支,由基金管理人支付给担保人。

6.4.3.2.2 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1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,043,916.40	527,673.88

注:基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2012年6月15日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	78,988,151.66	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	26,754,892.40	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	105,743,044.06	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.30%	0.00%

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	425,112,946.44	3,452,802.94	26,323,438.30	167,908.04

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.4 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300431	暴风科技	2015-6-10	重大事项	307.56	2015-7-13	276.80	20,205	144,263.70	6,214,249.80	-

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	39,197,375.51	0.85
	其中:股票	39,197,375.51	0.85
2	固定收益投资	1,234,587,000.00	26.80
	其中:债券	1,234,587,000.00	26.80
	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	1,599,524,939.30	34.72
	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	1,725,112,946.44	37.45
7	其他各项资产	8,485,071.92	0.18
8	合计	4,606,907,333.17	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	28,288,066.42	0.61
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	2,808,000.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,101,309.09	0.18
J	金融业	-	0.00
K	房地产业