大成策略回报混合型证券投资基金

2015 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:中国光大银行股份有限公司
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。

大成策略回报股票型证券投资基金经中国证监会证监许可[2008]1103号文核准募集,基金合同于2008年11月26日起生效。自基金合同生效以来,本基金运作平稳。根据中国证监会2014年7月7日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")的有关规定,经与本基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,自2015年7月22日起本基金名称变更为"大成策略回报混合型证券投资基金";基金简称变更为"大成策略回报混合";基金类别变更为"混合型"。基金代码保持不变,仍为090007。上述事项已报中国证监会备案。因上述变更基金名称及基金类别事宜,基金管理人对《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了相应修改。在修改过程中,基金管理人根据《运作办法》和基金运作实际情况,对《基金合同》的部分条款进行了必要的调整。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续及各项信息披露工作。

按照基金合同约定,本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形,不需要召开基金份额持有人大会。本基金更名后,《大成策略回报股票型证券投资基金基金合同》、《大成策略回报股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由大成策略回报混合型证券投资基金承担和继承。

基金托管人中国光大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有限公司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	大成策略回报混合
基金主代码	090007
交易代码	090007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月26日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	259,048,764.66份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期稳健增值,兼顾当期收益;同时,实施积极的分红政策,回报投资者。
投资策略	本基金在控制风险的前提下,采取趋势投资策略进行总体资产配置;在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略,以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益;同时,强调收益管理,实施收益管理策略,以期在增长期及时锁定收益,制度性地减少未来可能的下跌风险,增加投资总收益。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中债综合指数
风险收益特征	本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种,其长期平均的预期收益和风险低于股票基金,高于债券基金和货币市场基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	张建春
	联系电话	0755-83183388	010-63639180
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132

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 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心B座801 中国光大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	297,171,711.00	116,739,252.83	162,834,155.29
本期利润	221,804,192.12	146,506,124.37	187,476,531.82
加权平均基金份额本期利润	0.6787	0.2142	0.2021
本期基金份额净值增长率	43.75%	26.22%	24.19%
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	0.8273	0.1334	-0.0753
期末基金资产净值	473,362,574.88	613,808,286.28	881,004,980.41
期末基金份额净值	1.827	1.348	1.068

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。

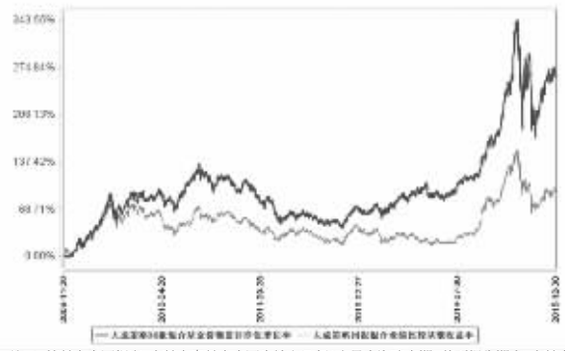
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	18.79%	1.77%	13.75%	1.34%	5.04%	0.43%
过去六个月	-1.19%	3.20%	-12.06%	2.14%	10.87%	1.06%
过去一年	43.75%	2.76%	7.09%	1.99%	36.66%	0.77%
过去三年	125.31%	1.84%	44.17%	1.44%	81.14%	0.40%
过去五年	67.87%	1.60%	24.06%	1.29%	43.81%	0.31%
自基金合同生效起至今	261.13%	1.59%	93.79%	1.35%	167.34%	0.24%

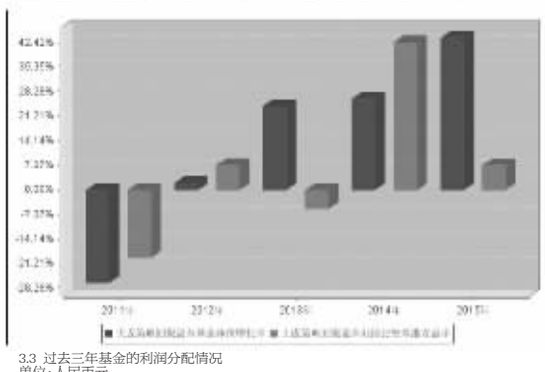
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、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,本基金的各项资产配置比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原"沪深300指数×80%+中信全债指数×20%"变更为"沪深300指数×80%+中债综合指数×20%"。

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
单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.810	18,456,664.37	16,549,157.74	35,005,822.11	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.810	18,456,664.37	16,549,157.74	35,005,822.11	

§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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐彦先生	本基金基金经理	2012年10月31日	-	10年	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部,2007年加入大成基金研究部,曾任中游制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日曾任景宏证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012年10月31日至2015年7月21日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理,2015年7月22日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2014年4月26日至2015年7月21日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理,2015年7月22日起任大成竞争优势混合型证券投资基金基金经理。2015年2月3日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2015年9月15日起任景阳领先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
刘旭先生	本基金经理助理	2015年3月30日	-	5年	管理学硕士,2009年至2010年在毕马威华振会计师事务所任审计师;2011年2月至2013年5月任广发证券研究所研究员;2013年5月加入大成基金管理有限公司。2015年3月30日至2015年7月21日担任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理助理。2015年7月22日至2015年7月28日任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理助理。2015年3月30日至2015年7月21日担任大成竞争优势混合型证券投资基金的基金经理助理。2015年7月22日至2015年7月28日担任大成竞争优势混合型证券投资基金的基金经理助理。2015年3月30日至2015年7月28日担任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理助理,2015年7月29日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。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》、《大成策略回报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,大成策略回报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,内容包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理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,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年基金业整体收益率堪比大牛市,这出乎我的意料。其中的过程跌宕起伏,幸好公募基金管理人由于股票仓位和金融工具使用的限制,不用快速在两者之间切换,否则收益率一定会像大部分所谓的绝对收益投资者一样低出不少,这也许能说明少即是多真是一条人生哲理。本基金的操作一贯不多,成功的操作是在六月份大跌之后将部分大市值股票换成了小市值股票,较为遗憾的操作是在九月末虽然看好市场并且仓位很高,但没有更有效率的使用资金,更多投资在自己有把握的股票上。

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1.827元,本报告期基金份额净值增长率为43.75%,同期业绩比较基准收益率为7.09%,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

展望将来,我认为市场需要回归常识,在中国,人们对常识有极大的分歧。但无论从哪个角度看,低价绩差股长期收益率高、炒股主要靠题材和内幕都不应该成为常识。如果这些成为了常识,说明一定有哪里出了问题。这些问题背后证券市场层面的原因是什么,社会层面的原因是什么,深究这些问题才具备了让市场回归常识的基础。

回归常识是许多人的期望,历史的发展很显然远远更复杂。全球不太稳定,比较而言中国的经济、金融体系要稳定得多,但这样的稳定也许蕴含了更大的不稳定。在中国传统的处事哲学下,不稳定不会立刻爆发,我们愿意以市场扭曲(在我的理念里,市场和市场扭曲都是中性词)为代价将问题留给时间来解决。这种方式成功了多次,这次能否成功很难预测。和从前不同的是,如今全球经济更是一个整体,而且普遍存在问题。各主要经济体和中国之间会相互把问题复杂化,更不用说和经济伴生的政治问题。

作为投资于国内市场且以年为周期的投资者,我不应也没有能力以中国甚至是全球的宏观经济/政治因素为变量做投资,即便这可能是当前的主要矛盾。国内传统经济的转型升级和新经济的创新迫在眉睫,也是我的主要关注点。在这里我提醒自己注意两点:1、任何政策,执行者需要有利益空间才会足够有效,2、口号式创新中短期内不会提高创新能力但会改变资源配置。

中国的回归常识之路要走很久,而且很艰难,我们要为此做好准备。

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。本报告期内本基金已分配利润35,005,822.11元(每十份基金份额分红0.81元),符合基金合同规定的分红比例。

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

2015年度,中国光大银行股份有限公司在大成策略回报混合型证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对大成策略回报混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2015年度,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——大成基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、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方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求;各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的"大成策略回报混合型证券投资基金2015年年度报告"进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§6 审计报告

本基金2015年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师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:大成策略回报混合型证券投资基金(原大成策略回报股票型证券投资基金)
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	108,988,767.90	64,219,550.79
结算备付金	92,145.11	370,794.09
存出保证金	180,336.19	141,707.67
交易性金融资产	368,905,858.39	549,574,964.79
其中:股票投资	368,905,858.39	519,532,964.79
基金投资	-	-
债券投资	-	30,042,000.00
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	-	-
应收证券清算款	-	2,366,347.42
应收利息	22,764.45	407,535.92
应收股利	-	-
应收申购款	115,395.69	37,067.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	478,305,267.73	617,117,967.99

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	-	-
应付证券清算款	2,374,136.34	-
应付赎回款	1,336,926.24	1,309,720.37
应付管理人报酬	614,445.21	797,246.87
应付托管费	102,407.51	132,874.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	90,767.27	432,395.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	424,010.28	637,444.14
负债合计	4,942,692.85	3,309,681.71
所有者权益:		
实收基金	259,048,764.66	455,461,265.97
未分配利润	214,313,810.22	158,347,020.31
所有者权益合计	473,362,574.88	613,808,286.28
负债和所有者权益总计	478,305,267.73	617,117,967.99

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.827元,基金份额总额259,048,764.66份。

7.2 利润表
会计主体:大成策略回报混合型证券投资基金(原大成策略回报股票型证券投资基金)
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	234,116,945.29	162,607,387.57
1.利息收入	1,045,913.37	1,682,489.30
其中:存款利息收入	416,199.40	345,889.59
债券利息收入	629,713.97	1,336,599.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	308,030,985.33	130,834,189.71
其中:股票投资收益	303,533,760.62	118,206,722.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	126,750.00	192,820.00
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	4,370,474.71	12,434,647.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-75,367,518.88	29,766,871.54
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	407,565.47	323,837.02
减:二、费用	12,312,753.17	16,101,263.20
1. 管理人报酬	8,187,438.34	11,131,476.81
2. 托管费	1,364,573.08	1,855,246.20
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,367,240.45	2,702,742.29
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	393,501.30	411,797.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	221,804,192.12	146,506,124.37
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	221,804,192.12	146,506,124.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:大成策略回报混合型证券投资基金(原大成策略回报股票型证券投资基金)
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)	455,461,265.97	158,347,020.31	613,808,286.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	221,804,192.12	221,804,192.12
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)	-196,412,501.31	-130,831,580.10	-327,244,081.41
其中:1.基金申购款	236,491,747.38	170,435,136.54	406,926,883.92
2.基金赎回款	-432,904,248.69	-301,266,716.64	-734,170,965.33
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)	-	-35,005,822.11	-35,005,822.11
五、期末所有者权益(基金净值)	259,048,764.66	214,313,810.22	473,362,574.88

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(基金净值)	824,929,105.69	56,075,874.72	881,004,980.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	146,506,124.37	146,506,124.37
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)	-369,467,839.72	-44,234,978.78	-413,702,818.50
其中:1.基金申购款	230,498,587.84	11,166,687.90	241,665,275.74
2.基金赎回款	-599,966,427.56	-55,401,666.68	-655,368,094.24
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)	455,461,265.97	158,347,020.31	613,808,286.28

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:

罗登攀_____ _____周立新_____ _____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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的其他会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.2.2 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。

7.4.2.3 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。

7.4.3 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。

7.4.4 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
中国光大银行股份有限公司("中国光大银行")	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
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

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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 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	8,187,438.34	11,131,476.81
其中:支付销售机构的客户维护费	1,579,302.83	2,254,347.59

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1.5%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 1.5% / 当年天数。

7.4.5.2.2 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托管费	1,364,573.08	1,855,246.20

注:支付基金托管人中国光大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。

7.4.5.2.3 销售服务费

无。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金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。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度基金管理人无投资本基金的情况。

7.4.5.4.2 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。

7.4.5.5 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12月31日		上年度可比期间 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
中国光大银行	108,988,767.90	405,186.34	64,219,550.79	329,061.65

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,按约定利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.6 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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
600759	洲际油气	2015年9月21日	重大事项停牌	8.62	-	-	2,262,580	22,099,667.69	19,503,439.60	-
600880	博瑞传播	2015年9月16日	重大事项停牌	11.38	2016年1月18日	8.25	164,520	3,567,826.04	1,872,237.60	-
300054	鼎龙股份	2015年11月23日	重大事项停