大成景益平稳收益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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	200,482,637.77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

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

§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6月26日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	325,214,908.32	134,615,233.05
本期利润	90,184,936.92	371,033,808.89
加权平均基金份额本期利润	0.1446	0.5046
本期基金份额净值增长率	4.11%	43.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.3000	0.1459
期末基金资产净值	299,616,295.53	1,575,410,782.62
期末基金份额净值	1.494	1.435

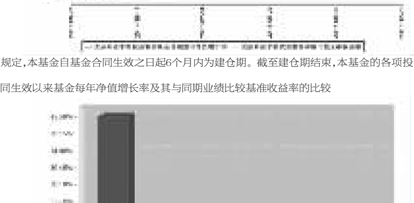
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 @ 2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

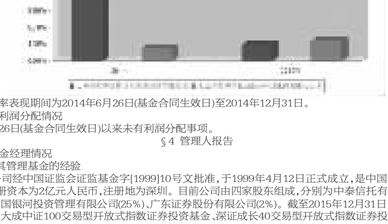
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.70%	1.19%	1.13%	0.01%	12.57%	1.18%
过去六个月	-5.92%	1.70%	2.37%	0.01%	-8.29%	1.69%
过去一年	4.11%	1.70%	5.20%	0.02%	-1.09%	1.68%
自基金合同生效起至今	49.40%	1.56%	8.58%	0.02%	40.82%	1.54%

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之日起6个月内为建仓期。截至建仓期结束,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。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:2014年净值增长率表现期间为2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2014年6月26日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

§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、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		
王磊先生	本基金基金经理	2014年6月26日	-	12年	经济学硕士。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理及总监(主持工作)。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日至2015年7月15日起担任大成强化收益债券型证券投基金基金经理,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。2015年12月14日起任大成行业轮动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	-	12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、离任日期均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年四季度,由于经济和通胀走势继续向下,央行保持宽松的货币政策,因此流动性继续保持宽松状态。2015年下半年以来,央行的货币政策调控思路发生了重大改变,由过去的盯货币供应量改成盯货币市场资金利率,这导致7天回购利率一直稳定在2.4%附近,虽然短端资金价格表现出相对以前更低的波动性,但是国内资产荒不断发酵,高收益非标资产大量到期面临的资产再配置压力和风险偏好下降和企业融资需求低迷使得符合投资要求的资产十分缺乏,从而带动债券收益率曲线的期限利差和中高等级信用债的信用利差大幅压缩。

权益市场方面,四季度,美联储加息在市场充分预期之后逐步兑现,对股市的压制显著减轻。国内经历若干次降准降息,流动性较为宽松,与此同时实体经济低迷,融资需求减弱,传统利率不敏感部门也无能力继续维持高杠杆,导致全市场高收益资产匮乏。就权益市场本身而言,经历二三季度巨幅下跌后,估值处于阶段性低位。这些因素促成了四季度权益市场的修复性上涨行情,其中成长股上涨尤为显著。

债券方面,本基金波段操作部分中长期利率债,在保持的信用债基础投资比例的同时严控信用风险,精选中高等级信用个券以获得较高的持有期回报。权益方面,本基金适当增加了权益仓位,主要选取了相对优质的成长股进行配置。

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1.494元,本报告期基金份额净值增长率为4.11%,同期业绩比较基准收益率为5.20%,低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

今年对债券市场的主要有利因素是供给侧改革背景下,风险偏好会受到压制,流动性仍然会堆积在安全资产上。但是利空因素也比较明显,一方面经济仍会比较低迷,结构调整、去杠杆和供给侧改革会成为今年的关键词,这会继续压制风险偏好和银行资产负债表,因此债券总体还是处于比较有利的宏观基本面环境之中。另一方面财政政策唱主角、货币政策退居次要位置,今年货币放水的幅度和频率都会明显低于去年,并且大概率就是稳定短期利率的一个相机抉择政策而已。同时财政支出加大会使得利率期限利差放量。同时债券估值已经处于历史高位,如果央行将短端利率持续固定在目前的水平上,债券的资本利得空间相比前两年也会大幅收缩。总体来看,预计今年债券资本回报较为有限,但收益率大幅反弹的空间也不大,仍具备一定的持有价值。本基金计划保持一定的债券仓位和中性偏长的久期水平,以获得债券持有期回报。

权益资产方面,由于美国经济向好,将进入持续加息通道,资金流出压力仍可能持续,而货币政策大量释放流动性的概率已不大,全市场流动性边际上可能已经形成拐点。与此同时,过去半年累积的大股东减持压力以及必将实施的注册制,都对权益市场特别是成长股构成较大压力。在具体方向上,供给侧改革有望逐步去周期化行业产能,同时促进这些行业整合重组,这有望带来相关板块的相对收益。而成长股由于估值相对偏高、减持压力大等因素,将面临较大的调整压力。未来本基金将适当降低权益仓位,并将侧重配置符合国家供给侧改革政策支持的相关行业,寻找有较强确定性的板块和个股进行投资。

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—大成基金管理有限公司 2015 年 1月 1日至 2015 年 12月31 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 审计报告

本基金2015年年度财务报表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:大成景益平稳收益混合型证券投资基金

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	5,541,238.19	140,235,298.48
结算备付金	11,224,477.09	29,990,575.08
存出保证金	737,742.64	283,497.84
交易性金融资产	426,699,194.07	1,912,739,975.12
其中:股票投资	88,069,483.87	404,526,430.85
基金投资	-	-
债券投资	338,629,710.20	1,508,213,544.27
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	5,000,000.00	10,902,754.69
应收利息	6,240,514.81	19,095,153.14
应收股利	-	-
应收申购款	-	958,155.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	455,443,166.80	2,114,205,409.45
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	154,999,805.00	502,699,984.70
应付证券清算款	20,436.60	32,254,849.93
应付赎回款	-	1,055,062.52
应付管理人报酬	204,990.55	942,823.75
应付托管费	64,059.55	294,632.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	351,029.57	1,314,054.31
应交税费	-	-
应付利息	16,549.80	72,294.22
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	170,000.20	160,924.98
负债合计	155,826,871.27	538,794,626.83
所有者权益:		
实收基金	200,482,637.77	1,097,696,187.40
未分配利润	99,133,657.76	477,714,595.22
所有者权益合计	299,616,295.53	1,575,410,782.62
负债和所有者权益总计	455,443,166.80	2,114,205,409.45

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值人民币1.494元,基金份额总额200,482,637.77份。

7.2 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6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	116,207,783.67	383,397,782.33
1.利息收入	30,186,166.08	12,420,517.50
其中:存款利息收入	857,489.11	381,726.91
债券利息收入	29,320,052.45	10,530,753.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,624.52	1,508,037.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	319,283,372.00	133,755,119.66
其中:股票投资收益	124,265,691.58	67,646,948.70
基金投资收益	-	-
债券投资收益	192,769,832.44	66,101,605.36
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	2,247,847.98	6,565.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-235,029,971.40	236,418,575.84
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,768,216.99	803,569.33
减:二、费用	26,022,846.75	12,363,973.44
1. 管理人报酬	7,696,365.53	3,398,043.75
2. 托管费	2,405,114.33	1,061,888.72
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,964,288.53	2,620,974.80
5. 利息支出	8,513,982.50	5,097,869.86
其中:卖出回购金融资产支出	8,513,982.50	5,097,869.86
6. 其他费用	443,095.86	185,196.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	90,184,936.92	371,033,808.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	90,184,936.92	371,033,808.89

7.3 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)	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)	-	90,184,936.92	90,184,936.92
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)	-897,213,549.63	-468,765,874.38	-1,365,979,424.01
其中:1.基金申购款	217,263,612.17	117,324,511.03	334,588,123.20
2.基金赎回款	-1,114,477,161.80	-586,090,385.41	-1,700,567,547.21
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)	200,482,637.77	99,133,657.76	299,616,295.53
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)	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)	-	371,033,808.89	371,033,808.89
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)	401,817,428.71	106,680,786.33	508,498,215.04
其中:1.基金申购款	552,109,637.63	118,799,618.75	670,909,256.38
2.基金赎回款	-150,292,208.92	-12,118,832.42	-162,411,041.34
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)	1,097,696,187.40	477,714,595.22	1,575,410,782.62

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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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、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。

7.4.2.3 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。

7.4.4 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
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
中泰信托有限责任公司	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。

7.4.5 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

7.4.5.1.1 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6月26日(基金合同生效日)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	448,741,603.47	10.43%	251,114,948.45	14.27%

7.4.5.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31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	313,360,931.71	13.73%	143,143,506.05	7.01%

7.4.5.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31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	10,533,249,000.00	27.55%	3,365,000,000.00	14.63%

7.4.5.1.4 权证交易

无。

7.4.5.1.5 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	411,846.38	10.60%	129,348.87	37.12%
关联方名称	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)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	226,455.93	14.30%	200,155.54	15.34%

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。

7.4.5.2 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6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,696,365.53	3,398,043.75
其中:支付销售机构的客户维护费	73,289.55	96,522.43

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。

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6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,405,114.33	1,061,888.72

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。

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
	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	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
	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	29,865,383.42	-	-	-	120,000,000.00	8,807.95

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

份额单位:份

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6月26日(基金合同生效日)至2014年12月31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	4.99%	0.91%

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。

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。

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6月26日(基金合同生效日)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
中国农业银行	5,541,238.19	521,834.18	140,235,298.48	253,837.32

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。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.5.7 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

金额单位:人民币元

7.4.6.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015/12/23	2016/1/8	新债未上市	100.00	100.00	700	70,000.00	70,000.00	-

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
600990	四创电子	2015/8/31	重大事项停牌	82.63	-	-	110,000	8,661,651.72	9,089,300.00	-
000796	凯撒旅游	2015/11/9	重大事项停牌	29.59	-	-	82,600	1,567,502.00	2,444,134.00	-
000901	航天科技	2015/8/19	重大事项停牌	42.13	2016/2/18	47.59	149,965	9,195,115.67	6,318,025.45	-
002707	众信旅游	2015/11/16	重大事项停牌	52.62	2016/3/15	47.36	41,400	1,587,022.24	2,178,468.00	-
300038	梅泰诺	2015/12/16	重大事项停牌	56.68	-	-	27,500	1,512,481.00	1,558,700.00	-

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

1.1.1.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

1.1.1.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末止,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49,999,805.00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
150203	15国开03	2016/1/4	103.36	500,000	51,680,000.00
合计				500,000	51,680,000.00

1.1.1.1.2 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105,000,000.00元,于2016年1月4日到期。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。

§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	88,069,483.87	19.34
	其中:股票	88,069,483.87	19.34
2	固定收益投资	338,629,710.20	74.35
	其中:债券	338,629,710.20	74.35
	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	16,765,715.28	3.68
7	其他各项资产	11,978,257.45	2.63
8	合计	455,443,166.80	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	68,084,942.45	22.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	44,645.00	0.01
F	批发和零售业	4,397,843.00	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	2,444,134.00	0.82
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,776,952.62	1.93
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	3,683,458.80	1.23
L	租赁和商务服务业	2,178,468.00	0.73
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	1,459,040.00	0.49
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	88,069,483.87	29.39

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	002292	奥飞动漫	199,200	10,300,632.00	3.44
2	600990	四创电子	110,000	9,089,300.00	3.03
3	300327	中颖电子	198,100	7,864,570.00	2.62
4	002224	三 力 士	320,200	6,954,744.00	2.32
5	000901	航天科技	149,965	6,318,025.45	2.11
6	002460	赣锋锂业	90,000	5,663,700.00	1.89
7	001979	招商蛇口	176,580	3,683,458.80	1.23
8	000977	浪潮信息	116,000	3,678,360.00	1.23
9	300367	东方网力	50,000	3,485,000.00	1.16
10	300113	顺网科技	31,126	3,155,242.62	1.05

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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	600875	东方电气	161,724,993.66	10.27
2	600050	中国联通	113,849,891.53	7.23
3	601318	中国平安	108,371,840.17	6.88
4	600219	南山铝业	87,541,556.16	5.56
5	603993	洛阳钼业	55,352,682.08	3.51
6	601688	XD华泰证	52,813,820.01	3.35
7	000800	一汽轿车	52,616,755.37	3.34
8	000001	平安银行	50,549,497.00	3.21
9	002285	世联行	47,376,298.30	3.01
10	600325	华发股份	46,241,364.27	2.94
11	600446	金证股份	43,156,982.76	2.74
12	002230	科大讯飞	42,140,867.24	2.67
13	601628	中国人寿	41,243,782.77	2.62
14	601989	中国重工	39,729,910.00	2.52
15	002146	荣盛发展	34,879,686.47	2.21
16	002465	海格通信	34,059,452.50	2.16
17	600795	国电电力	33,951,540.67	2.16
18	000802	北京文化	31,387,006.57	1.99
19	600376	首开股份	31,379,463.28	1.99
20	300036	超图软件	30,756,580.12	1.95

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。

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	600875	东方电气	167,048,354.40	10.60
2	600050	中国联通	104,812,888.60	6.65
3	601318	中国平安	102,796,254.82	6.53
4	600219	南山铝业	91,474,969.35	5.81
5	601688	XD华泰证	85,713,472.34	5.44
6	600036	招商银行	77,922,016.66	4.95
7	002465	海格通信	65,269,993.41	4.14
8	603993	洛阳钼业	61,615,591.32	3.91
9	600446	金证股份	55,838,051.74	3.54
10	000800	一汽轿车	54,484,295.10	3.46
11	002230	科大讯飞	53,840,031.95	3.42
12	000001	平安银行	51,231,586.84	3.25
13	600325	华发股份	44,873,257.75	2.85
14	601166	兴业银行	44,595,723.05	2.83
15	600185	格力地产	44,216,952.09	2.81
16	601628	中国人寿	43,248,249.80	2.75
17	002146	荣盛发展	40,470,189.49	2.57
18	600376	首开股份	40,128,270.24	2.55
19	002285	世联行	39,210,686.80	2.49
20	000958	东方能源	37,523,447.00	2.38
21	601989	中国重工	35,757,726.19	2.27
22	600795	国电电力	34,566,562.87	2.19

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。

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	2,196,867,153.98
卖出股票收入(成交)总额	2,588,136,334.19

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	757,925.70	0.25
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	71,720,000.00	23.94
	其中:政策性金融债	71,720,000.00	23.94
4	企业债券	136,040,411.40	45.40
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债(可交换债)	130,111,373.10	43.43
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	338,629,710.20	113.02

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	113008	电气转债	450,000	61,951,500.00	20.68
2	150203	15国开03	500,000	51,680,000.00	17.25
3	132001	14宝钢EB	221,360	34,257,673.60	11.43
4	128009	歌尔转债	240,850	33,832,199.50	11.29
5	124573	14龙岩城	200,000	20,940,000.00	6.99

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。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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	737,742.64
2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	6,240,514.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,978,257.45

8.12.4 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	113008	电气转债	61,951,500.00	20.68
2	128009	歌尔转债	33,832,199.50	11.29
3	132001	14宝钢EB	34,257,673.60	11.43

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	600990	四创电子	9,089,300.00	3.03	重大事项停牌
2	000901	航天科技	6,318,025.45	2.11	重大事项停牌

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

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
515	389,286.68	186,325,245.53	92.94%	14,157,392.24	7.06%

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	1,252,420.91	0.62%

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	50~100
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(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	217,263,612.17
减:本报告期基金总赎回份额	1,114,477,161.80
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	200,482,637.77

§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

无。

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),本年度支付的审计费用为7万元整。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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	741,636,603.35	17.23%	657,318.50	16.91%	-
瑞银证券	1	464,676,200.63	10.80%	423,040.27	10.88%	-
光大证券	2	448,741,603.47	10.43%	411,846.38	10.60%	-
国信证券	1	408,364,942.67	9.49%	371,774.54	9.56%	-
北京高华	1	361,582,045.37	8.40%	329,182.30	8.47%	-
中信建投	2	227,797,749.28	5.29%	207,384.33	5.34%	-
国金证券	2	203,299,249.93	4.72%	180,867.57	4.65%	-
上海证券	1	187,548,457.10	4.36%	170,743.88	4.39%	-
浙商证券	1	178,662,524.55	4.15%	158,101.04	4.07%	-
银河证券	4	157,024,887.44	3.65%	141,448.93	3.64%	-
民生证券	1	90,459,206.32	2.10%	82,353.55	2.12%	-
中银国际	2	89,919,019.22	2.09%	81,862.81	2.11%	-
华创证券	1	87,534,213.67	2.03%	77,460.22	1.99%	-
方正证券	1	86,801,306.53	2.02%	79,024.20	2.03%	-
国盛证券	1	83,490,580.33	1.94%	75,944.14	1.95%	-
广发证券	1	75,047,681.96	1.74%	68,323.54	1.76%	-
中泰证券	1	67,014,171.33	1.56%	61,208.79	1.57%	-
东北证券	2	60,125,585.40	1.40%	54,738.58	1.41%	-
招商证券	2	59,124,200.50	1.37%	52,319.11	1.35%	-
兴业证券	2	52,365,502.83	1.22%	46,365.56	1.19%	-
东兴证券	1	50,297,323.48	1.17%	44,508.04	1.15%	-
联讯证券	1	45,975,024.33	1.07%	41,898.90	1.08%	-
华泰证券	1	29,733,810.82	0.69%	26,311.96	0.68%	-
国泰君安	2	26,133,273.14	0.61%	23,815.58	0.61%	-
平安证券	1	20,918,819.30	0.49%	19,044.43	0.49%	-
山西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
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%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

本基金本报告期末新增交易单元:第一创业、山西证券、联讯证券、华西证券、川财证券,退租交易单元:中信建投。

1.1.1 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
海通证券	78,554,125.99	3.44%	567,636,000.00	1.48%	-	0.00%
瑞银证券	188,642,930.62	8.27%	6,326,300,000.00	16.55%	-	0.00%
光大证券	313,360,931.71	13.73%	10,533,249,000.00	27.55%	-	0.00%
国信证券	214,586,877.50	9.41%	3,388,000,000.00	8.86%	-	0.00%
北京高华	385,111,019.10	16.88%	7,364,300,000.00	19.26%	-	0.00%
中信建投	34,837,199.73	1.53%	592,535,000.00	1.55%	-	0.00%
国金证券	27,836,536.12	1.22%	464,000,000.00	1.21%	-	0.00%
上海证券	132,449,193.30	5.81%	2,741,700,000.00	7.17%	-	0.00%
浙商证券	15,937,349.05	0.70%	98,000,000.00	0.26%	-	0.00%
银河证券	72,357,707.63	3.17%	660,000,000.00	1.73%	-	0.00%
民生证券	98,561,132.60	4.32%	1,145,000,000.00	2.99%	-	0.00%
中银国际	79,690,325.00	3.49%	310,000,000.00	0.81%	-	0.00%
华创证券	14,089,978.19	0.62%	65,500,000.00	0.17%	-	0.00%
方正证券	165,562,191.98	7.26%	530,300,000.00	1.39%	-	0.00%
国盛证券	93,901,880.20	4.12%	262,000,000.00	0.69%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	279,700,000.00	0.73%	-	0.00%
中泰证券	37,936,481.90	1.66%	1,155,400,000.00	3.02%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	820,000,000.00	2.14%	-	0.00%
招商证券	281,874,800.21	12.35%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	353,900,000.00	0.93%	-	0.00%
东兴证券	33,418,954.42	1.46%	125,000,000.00	0.33%	-	0.00%
联讯证券	9,577,635.25	0.42%	1,000,000.00	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	13,000,000.00	0.03%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	18,000,000.00	0.05%	-	0.00%
平安证券	3,290,000.00	0.14%	150,000,000.00	0.39%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	270,000,000.00	0.71%	-	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