大成可转债增强债券型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料已经审计。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	大成可转债增强债券
基金主代码	090017
交易代码	090017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月30日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,354,891.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下,采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略,通过主动投资组合管理,充分把握可转债兼具股性和债性的风险收益特征,追求投资资金的长期保值增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债等固定收益类资产,在确保基金资产收益安全与稳定的同时,以有限的风险载荷博取股票市场的上涨收益。本基金将在基金合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析,自上而下地实施整体资产配置策略,通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求状况、信用风险变化情况和有关政策法律法规等因素的综合分析,预测各大类资产未来收益率变化情况,在不同的大类资产之间进行动态调整和优化,以规避市场风险,把握市场收益变化,进而提高基金收益率。
业绩比较基准	中信标普可转债指数×60%+中债综合指数×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券(含可分离交易可转债),在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	洪渊
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798

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156号中国工商银行托管业务部

§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	18,125,341.01	15,327,763.24	4,776,458.22
本期利润	-54,923,298.43	92,984,978.62	192,991.47
加权平均基金份额本期利润	-0.2734	1.2978	0.0024
本期基金份额净值增长率	-16.86%	79.80%	-4.15%
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	0.1509	0.1633	-0.0199
期末基金资产净值	56,176,859.18	273,113,622.04	59,949,097.29
期末基金份额净值	1.465	1.762	0.980

注:1.本期已实现收益指本期利息收入、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。

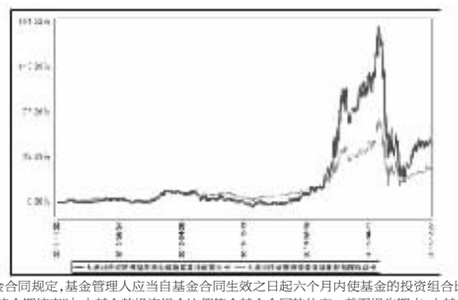
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

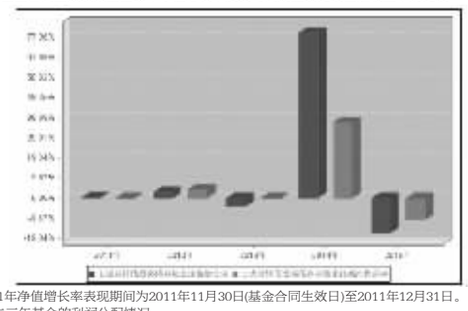
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.65%	1.41%	4.35%	0.76%	9.30%	0.65%
过去六个月	-15.32%	2.56%	-6.87%	1.95%	-8.45%	0.61%
过去一年	-16.86%	2.87%	-10.54%	1.89%	-6.32%	0.98%
过去三年	43.29%	1.87%	21.51%	1.18%	21.78%	0.69%
自基金合同生效起至今	47.88%	1.60%	26.42%	1.01%	21.46%	0.59%

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:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末,本基金投资的南京新百(600682)因市场行情波动剧烈,导致单个股票的投资比例被动超标,在报告期末该股票停牌。除此之外,报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同规定。

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:2011年净值增长率表现期间为2011年11月30日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

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	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
2013	0.1000	770,631.08	442,730.83	1,213,361.91	-
合计	0.1000	770,631.08	442,730.83	1,213,361.91	-

§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		
王辰先生	本基金基金经理	2013年11月9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

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》、《大成可转债增强债券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,大成可转债增强债券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,股票市场出现了较大波动。在上半年,一系列的因素导致大量资金进入股票市场,使上半年股票市场出现快速上涨。这些因素主要包括:货币政策持续宽松,国家为了经济转型的需要也大力支持改革创新,部分上市公司进行兼并重组,两融业务出现快速增长和杠杆资金的大量运用。在这些因素中,杠杆资金是推动股市上涨的重要力量,但其隐藏的杀伤力同样巨大。在8月份,由于监管机构开始清查违规资金入市,导致杠杆资金的连续杀跌,并形成连锁效应,导致市场出现了快速的无量下跌,部分交易日市场几乎整体跌停。为了避免整体的金融风险,维持证券市场稳定,国家进行了积极的干预政策,使市场趋于稳定,市场在9月份开始出现反弹,年底大致收盘于股灾发生前位置。市场虽然全年仍然取得正收益,但波动剧烈,操作难度较大。对应到转债市场,中证转债指数上半年表现较好,但下半年表现较差。全年指数跌幅为26.54%。同时,部分转债在上半年相继转股,导致可投资的转债品种急剧减少,也加大了产品操作的难度。

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1.465元,本报告期份额净值增长率为-16.86%,同期业绩比较基准增长率为-10.54%,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

2016年,我们认为,主导市场的因素更加复杂多变。一是宏观经济形式仍然较弱,短期内难言触底回升,二是货币政策虽然仍将保持适度宽松,但其力度要弱于2015年。同时,国际经济形势,特别是美国的经济走势和美元走势以及其对于人民币汇率的影响,也是需要考虑的重要因素。综合考虑,我们认为,2016年的市场仍将维持一定波动,但向下的空间较为有限。我们将根据市场的情况,主动积极的做好仓位控制和个股选择,争取获得较好回报。同时,2016年部分新的转债品种发行,也会带来一定的投资机会,我们将增加对于新发转债品种的研究,争取发现新的投资机会。

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

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,本基金托管人在对大成可转债增强债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,大成可转债增强债券型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成可转债增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,大成可转债增强债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成可转债增强债券型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:大成可转债增强债券型证券投资基金

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	1,122,892.70	45,517,848.07
结算备付金	2,086,810.29	1,999,994.99
存出保证金	90,623.78	29,435.38
交易性金融资产	76,397,789.18	375,217,670.75
其中:股票投资	11,096,200.68	4,342,919.57
基金投资	-	-
债券投资	65,301,588.50	370,874,751.18
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	-	-
应收利息	363,341.19	1,294,718.66
应收股利	-	-
应收申购款	12,235.31	3,831,934.96
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	80,073,692.45	427,891,602.81
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	23,500,000.00	125,000,000.00
应付证券清算款	4,651.92	28,658,772.85
应付赎回款	105,944.47	709,630.22
应付管理人报酬	49,852.18	187,613.27
应付托管费	9,970.45	37,522.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	33,652.73	1,310.38
应交税费	42,682.00	42,682.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,079.52	140,449.41
负债合计	23,896,833.27	154,777,980.77
所有者权益:		
实收基金	38,354,891.37	154,999,331.79
未分配利润	17,821,967.81	118,114,290.25
所有者权益合计	56,176,859.18	273,113,622.04
负债和所有者权益总计	80,073,692.45	427,891,602.81

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.465元,基金份额总额38,354,891.37份。

7.2 利润表

会计主体:大成可转债增强债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	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	-44,898,078.23	95,388,942.65
1.利息收入	3,995,362.82	945,102.12
其中:存款利息收入	339,331.48	49,312.92
债券利息收入	3,648,049.12	895,789.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,982.22	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	23,800,470.81	16,775,674.50
其中:股票投资收益	69,187,512.64	896,891.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-45,652,109.29	15,808,670.40
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	265,067.46	70,112.65
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-73,048,639.44	77,657,215.38
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	354,727.58	10,950.65
减:二、费用	10,025,220.20	2,403,964.03
1. 管理人报酬	3,710,768.69	805,233.43
2. 托管费	742,153.76	161,046.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,961,579.01	39,850.38
5. 利息支出	3,228,127.78	1,235,776.27
其中:卖出回购金融资产支出	3,228,127.78	1,235,776.27
6. 其他费用	382,590.96	162,057.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-54,923,298.43	92,984,978.62
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-54,923,298.43	92,984,978.62

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成可转债增强债券型证券投资基金

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)	154,999,331.79	118,114,290.25	273,113,622.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-54,923,298.43	-54,923,298.43
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)	-116,644,440.42	-45,369,024.01	-162,013,464.43
其中:1.基金申购款	704,515,464.75	607,219,924.86	1,311,735,389.61
2.基金赎回款	-821,159,905.17	-652,588,948.87	-1,473,748,854.04
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)	38,354,891.37	17,821,967.81	56,176,859.18

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)	61,163,232.29	-1,214,135.00	59,949,097.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,984,978.62	92,984,978.62
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)	93,836,099.50	26,343,446.63	120,179,546.13
其中:1.基金申购款	146,749,418.85	39,211,902.45	185,961,321.30
2.基金赎回款	-52,913,319.35	-12,868,455.82	-65,781,775.17
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)	154,999,331.79	118,114,290.25	273,113,622.04

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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 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。

7.4.3 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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。

7.4.5 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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	3,710,768.69	805,233.43
其中:支付销售机构的客户维护费	881,476.91	166,445.50

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1.00%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×1.00%÷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	742,153.76	161,046.64

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行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

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1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2011年11月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	30,000,600.02	30,000,600.02
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	30,000,600.02	-
期末持有的基金份额	-	30,000,600.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	19.36%

注:基金管理人大成基金于本会计年度赎回本基金的交易委托大成直销办理,申赎本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

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。

7.4.5.5 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
中国工商银行	1,122,892.70	167,451.06	45,517,848.07	39,406.59

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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。

7.4.5.7 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
600682	南京新百	2015年7月1日	重大事项停牌	32.97	2016年1月27日	33.78	299,844	6,352,144.13	9,885,856.68	-

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。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 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。

7.4.6.3.2 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23,500,000.00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	11,096,200.68	13.86
	其中:股票	11,096,200.68	13.86
2	固定收益投资	65,301,588.50	81.55
	其中:债券	65,301,588.50	81.55
	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	3,209,702.99	4.01
7	其他各项资产	466,200.28	0.58
8	合计	80,073,692.45	100.00

8.2 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	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	919,344.00	1.64
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	9,885,856.68	17.60
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	-	0.00
J	金融