大成睿景灵活配置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:广发证券股份有限公司
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。

基金托管人广发证券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5月26日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成睿景灵活配置混合	
基金主代码	001300	
交易代码	001300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月26日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,854,029,834.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码:	001300	001301
报告期末下属分级基金的份额总额	1,922,323,183.11份	931,706,651.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济转型期的成长股投资机会,本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在控制风险前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析,研判经济周期在美林投资时钟理论所处的阶段,综合评价各类资产市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将权衡、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于货币市场基金与债券型基金,属于风险水平中高的基金。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	王玮
	联系电话	0755-83183388	020-87555888-6052
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4008885558	95575
传真		0755-83199588	020-87555129

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 广东省广州市天河区天河北路183号大都会广场41楼

§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5月26日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	大成睿景灵活配置混合A	大成睿景灵活配置混合C
本期已实现收益	-681,028,182.31	-382,366,223.39
本期利润	-528,385,558.39	-318,988,606.51
加权平均基金份额本期利润	-0.2448	-0.2771
本期基金份额净值增长率	-15.30%	-15.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.2917	-0.2969
期末基金资产净值	1,628,795,994.63	784,770,318.66
期末基金份额净值	0.847	0.842

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

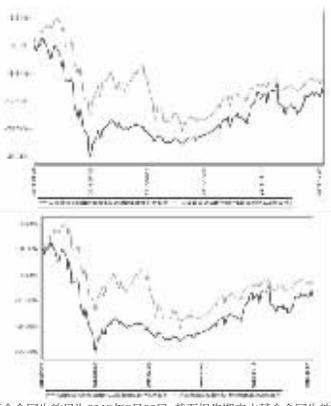
大成睿景灵活配置混合A

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%	1.85%	15.59%	1.22%	3.20%	0.63%
过去六个月	6.14%	1.78%	-5.69%	1.94%	11.83%	-0.16%
自基金合同生效起至今	-15.30%	1.96%	-11.86%	1.98%	-3.44%	-0.02%

大成睿景灵活配置混合C

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	18.59%	1.85%	15.59%	1.22%	3.00%	0.63%
过去六个月	5.51%	1.78%	-5.69%	1.94%	11.20%	-0.16%
自基金合同生效起至今	-15.80%	1.96%	-11.86%	1.98%	-3.94%	-0.02%

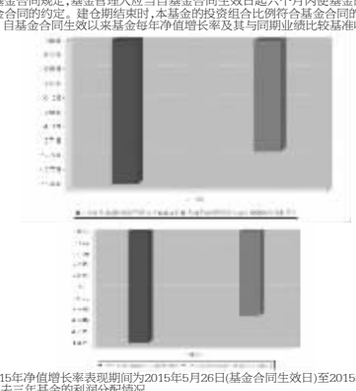
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同生效日为2015年5月26日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效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。

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:2015年净值增长率表现期间为2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2015年5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65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		
李本刚先生	本基金基金经理、股票投资部总监	2015年9月18日	-	15年	管理学硕士。2001年至2010年先后就职于西南证券股份有限公司、中关村证券股份有限公司和建信基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员。2010年8月加入大成基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、行业研究主管。2012年9月4日至2015年7月1日任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理,2015年7月2日起任大成内需增长混合型证券投资基金基金经理,2014年4月16日至2015年7月2日任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理,2014年7月21日任大成消费主题混合型证券投资基金基金经理,2014年5月14日至2015年5月26日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年9月18日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
焦巍先生	本基金基金经理	2015年5月26日	2015年9月30日	17年	金融学博士。1994年9月至1998年9月任中国银行海南分行国际结算部科员。1998年9月至2001年6月任湘财合丰基金管理有限公司研究部研究员。2003年1月至2006年6月任汉唐证券资金管理中心高级交易员。2009年9月至2014年9月任平安大华基金投资研究部投资总监。2014年9月加入大成基金管理有限公司,自2015年2月至2015年8月任股票投资部总监,自2015年5月至2015年8月任公司首席投资官,2015年3月28日至2015年9月30日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年3月28日至2015年7月2日任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理,2015年7月3日至2015年9月30日任大成景阳领先混合型证券投资基金基金经理。2015年5月26日至2015年9月30日任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈龙先生	本基金基金经理助理	2015年12月1日	-	4年	经济学硕士。2012年7月至2015年1月任大成基金管理有限公司研究部助理研究员。2015年2月至2015年3月任南方基金管理有限公司固定收益部研究员。2015年4月至2015年12月任交银施罗德基金管理有限公司研究部高级研究员。2015年12月加入大成基金管理有限公司,任股票投资部专职助理。2015年12月1日起担任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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》、《大成睿景灵活配置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,大成睿景灵活配置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

经历过两次股灾之后,我们认为,市场的微观结构已经改善,政府救市得到了较好的效果,市场进入了底部运行区间。9月末,我们预计四季度宏观经济将会企稳,全年能够维持在6.9%左右的增速,通胀水平仍然很低,流动性继续宽松(央行在三季度货币政策执行报告中提到,货币政策将不仅仅依据CPI,而是要综合考虑GDP平减指数等其他价格指标)。正如我们所预计的,四季度上证综指上涨15.9%,创业板指数上涨30.3%。

我们的操作也是在9月底开始加大对大股市场的仓位配置,一度达到90%的仓位水平。在行业选择上,我们认为前期超跌反弹个股存在较大的机会,因此精选了其中的很多个股。四季度后半期,VR、IP、量子通信等概念被市场炒作,我们也是基于深入的研究,深度参与了这些主要的概念个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,大成睿景灵活配置混合A份额净值增长率为-15.30%,大成睿景灵活配置混合C份额净值增长率为-15.80%,同期业绩比较基准增长率为-11.86%,基金份额净值增长率低于同期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

我们认为,(1)美联储加息是2016年最确定的事;(2)欧元区经济复苏超市场预期,欧央行货币政策边际收紧可能成为2016年最大的"黑天鹅";(3)地缘政治问题重新抬头,成为2016年重要的风险因素;(4)国内经济正式进入去产能周期,失业率提升、银行坏账上升和信用违约频发成为主流;(5)财政政策积极顺应供给侧改革,货币政策积极应对人民币汇率贬值带来的基础货币被动收紧,在无通胀压力下,降息仍会延续。

从基本面角度看,转型期经济体的权益市场主要决定因素是无风险利率和风险偏好。货币政策持续宽松带来以10年期金融债为主要标志的无风险利率仍有进一步下行空间,泛亚事件后带来的信用风险逐步提升使得市场认为的无风险利率回归至国债和金融债正常轨道上来。资产荒和准备预期将会进一步推升市场风险偏好的提升,尽管在时间上可能存在不一致的矛盾。从资金层面看,2016年股票供给和资金供给都会进一步增大,IPO重启、注册制改革、战略新兴板和新三板的扩容,加上2016年初上市公司控股股东等的解禁都会带来股票供给的增加;然而,居民存款"搬家"、理财产品和保险资金的增加配置、深港通和加入MSCI、养老金入市等都会带来较大的资金供给。综合来看,我们认为2016年仍然是股票市场的牛市之年,预计创业板和上证综指均有较大的涨幅,在风格上,我们更加看好以创业板为主的符合中国经济转型方向的成长性股票。对房地产、金融、建筑建材及上游原材料等均表示谨慎。

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。本基金自2015年5月26日(基金合同生效日)以来未有利润分配事项。

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睿景灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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,大成睿景灵活配置混合型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成睿景灵活配置混合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,大成睿景灵活配置混合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睿景灵活配置混合型证券投资基金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:大成睿景灵活配置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
资 产:	
银行存款	194,761,105.39
结算备付金	20,134,096.95
存出保证金	8,733,344.66
交易性金融资产	2,201,872,391.47
其中:股票投资	2,201,872,391.47
基金投资	-
债券投资	-
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	17,289,458.44
应收利息	66,418.60
应收股利	-
应收申购款	1,097,063.94
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,443,953,879.45
负债和所有者权益	本期末 2015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	15,478,432.49
应付赎回款	3,466,559.76
应付管理人报酬	2,988,508.88
应付托管费	498,084.80
应付销售服务费	526,507.19
应付交易费用	7,238,127.02
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	191,346.02
负债合计	30,387,566.16
所有者权益:	
实收基金	2,854,029,834.24
未分配利润	-440,463,520.95
所有者权益合计	2,413,566,313.29
负债和所有者权益总计	2,443,953,879.45

注:1.报告截止日2015年12月31日,大成睿景混合基金A类基金份额净值0.847元,大成睿景混合基金C类基金份额净值0.842元;基金份额总额2,854,029,834.24份,其中大成睿景混合基金A类基金份额1,922,323,183.11份,大成睿景混合基金C类基金份额931,706,651.13份。

2.本财务报表的实际编制期间为2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间,截止报告期末本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体:大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	-792,875,269.71
1.利息收入	5,875,434.14
其中:存款利息收入	5,874,655.37
债券利息收入	778.77
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)	-1,017,072,504.24
其中:股票投资收益	-1,020,758,365.00
基金投资收益	-
债券投资收益	2,396,844.83
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	1,289,015.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	216,020,240.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,301,559.59
减:二.费用	54,498,895.19
1. 管理人报酬	23,577,867.52
2. 托管费	3,929,644.49
3. 销售服务费	4,367,091.49
4. 交易费用	22,383,431.69
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	240,860.00
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-847,374,164.90
减:所得税费用	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-847,374,164.90

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成睿景灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月26日(基金合同生效日)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)	4,235,507,340.87	-	4,235,507,340.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-847,374,164.90	-847,374,164.90
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)	-1,381,477,506.63	406,910,643.95	-974,566,862.68
其中:1.基金申购款	296,401,156.43	-69,291,742.32	227,109,414.11
2.基金赎回款	-1,677,878,663.06	476,202,386.27	-1,201,676,276.79
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)	2,854,029,834.24	-440,463,520.95	2,413,566,313.29

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 基金基本情况

大成睿景灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第784号《关于核准大成睿景灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,234,533,704.77元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第582号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,235,507,340.87份基金份额,其中认购资金利息折合973,636.10份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购、申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购、申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额,称为C类。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。两类份额之间不能转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券等固定收益类投资工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等)、股指期货、权证、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为0-95%;债券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产占基金资产比例不低于5%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资业绩比较基准为:中证500指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于2016年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年5月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4