大成可转债增强债券型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成可转债增强债券
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
报告期末基金份额总额	340,766,026.33份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	6,595,954.02
2.本期利润	16,198,822.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0383
4.期末基金资产净值	649,662,902.78
5.期末基金份额净值	1.906

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(不含公允价值变动损益)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。

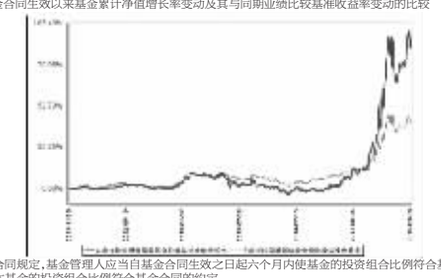
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	8.17%	2.48%	0.38%	1.17%	7.79%	1.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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11月9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日起担任大成强化收益债券型证券投基金基金经理。2013年7月17日起担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日起担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日起担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

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 管理人对投资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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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年1季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在10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%的交易情形共计1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年1季度,股票市场出现了较为明显的分化。以创业板为代表的中小盘股票出现了较大幅度上涨,而大盘股则表现不佳。从市场指数上看,创业板指数本季度上涨58.67%,沪深300指数上涨14.64%,上证50指数上涨6.7%。

由于转债对应的正股以中大盘股居多,受大盘股指数表现不佳的影响,中证转债指数表现不佳,本季度下跌了0.59%。而且,部分的转债品种临续到期,也使本产品的可投资标的减少,增加了投资的难度。

在本季度,本基金适当减少了转债的投资比例,并增加了股票投资的比例。在股票的选择上,本产品主要投资方向为互联网医疗、TMT、电子等行业,获得了一定的收益。

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1.906元,本报告期份额净值增长率为8.17%,同期业绩比较基准增长率为0.38%,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

展望下一季度,我们认为,在高层领导支持经济结构转型,产业升级创新,以及央行保持宽松货币政策的大背景下,股票市场仍然具有较好的上涨机会。我们仍然会保持对于股票的较高投资比例。在转债方面,我们将优选部分正股具有较好上涨前景且溢价率水平合理的转债品种进行投资。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	124,291,368.76	15.14
	其中:股票	124,291,368.76	15.14
2	固定收益投资	626,683,333.90	76.33
	其中:债券	626,683,333.90	76.33
	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	59,005,636.32	7.19
7	其他资产	11,040,959.98	1.34
8	合计	821,021,298.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	56,289,581.38	8.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	3,173,000.00	0.49
F	批发和零售业	26,487,229.00	4.08
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	21,710,000.00	3.34
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	12,540,520.00	1.93
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,091,038.38	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
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	124,291,368.76	19.13

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300096	易联众	1,000,000	21,710,000.00	3.34
2	603899	晨光文具	549,850	18,727,891.00	2.88
3	002251	步步高	649,990	17,614,729.00	2.71
4	002009	天奇股份	400,103	11,594,984.94	1.78
5	600511	国药股份	250,000	8,872,500.00	1.37
6	600185	格力地产	320,000	8,732,800.00	1.34
7	002236	大华股份	200,000	7,310,000.00	1.13
8	002256	彩虹精化	232,000	5,206,080.00	0.80
9	300053	欧比特	150,000	4,546,500.00	0.70
10	601226	华电重工	199,953	4,091,038.38	0.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,003,600.00	0.31
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	45,857,000.00	7.06
	其中:政策性金融债	45,857,000.00	7.06
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	578,822,733.90	89.10
8	其他	-	0.00
9	合计	626,683,333.90	96.46

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	1,330,600	182,651,462.00	28.11
2	113501	洛钼转债	600,000	105,066,000.00	16.17
3	110029	浙能转债	644,800	89,878,672.00	13.83
4	128009	歌尔转债	518,978	85,517,194.84	13.16
5	018001	国开1301	350,000	35,854,000.00	5.52

5.6 报告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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	232,854.78
2	应收证券清算款	6,176,132.48
3	应收股利	-
4	应收利息	1,689,017.73
5	应收申购款	2,942,954.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,040,959.98

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	182,651,462.00	28.11
2	110028	冠城转债	31,629,327.90	4.87
3	125089	深机转债	30,558,364.38	4.70
4	113006	深燃转债	17,138,151.60	2.64
5	113007	吉视转债	15,950,475.20	2.46
6	110012	海运转债	10,046,409.20	1.55
7	128006	长青转债	6,626,818.38	1.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300053	欧比特	4,546,500.00	0.70	重大事项停牌

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	154,999,331.79
报告期期间基金总申购份额	588,797,302.88
减:报告期期间基金总赎回份额	403,030,608.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	340,766,026.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初基金份额持有人持有的本基金份额	30,000,600.02
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	30,000,600.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	8.80

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成可转债增强债券型证券投资基金的文件;

2、《大成可转债增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《大成可转债增强债券型证券投资基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2015年4月18日

大成蓝筹稳健证券投资基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成蓝筹稳健混合
交易代码	090003
前端交易代码	090003
后端交易代码	091003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月3日
报告期末基金份额总额	10,288,676,082.24份
投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制非系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例;行业配置采取较为积极的策略,以投资基准的行业权重为基础,以行业研究及比较分析为核心,通过适时增大或降低相应行业的投资权重,使整体投资表现跟上或超越投资基准;个股选择策略则采用蓝筹成分股优选策略,运用"价值-势头"选股方法,优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资。
业绩比较基准	天相280指数×70%+中信标普固债指数×30%
风险收益特征	本基金属于较低风险证券投资基金,适于承受一定风险,追求当期收益和长期资本增值的基金投资人。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	987,365,107.52
2.本期利润	1,942,442,852.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.1787
4.期末基金资产净值	9,381,644,037.82
5.期末基金份额净值	0.9118

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 本报告期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	净值增长率①	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	24.67%	1.57%	9.88%	1.28%	14.79%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》,本基金投资股票比例为基金资产净值的30%~95%,投资债券比例为基金资产净值的0%~65%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,法律法规另有规定时从其规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
戈兆华先生	本基金基金经理	2013年11月25日	-	14年	经济学硕士。2001年至2005年,在华夏基金管理有限公司从事产品开发工作。2006年加入大成基金管理有限公司,历任规划发展部总监助理、副总监、总经理办公室主任兼公司战略发展委员会秘书、数量投资部总监及研究部总监。2013年11月25日起任大成蓝筹稳健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 管理人对投资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》、《大成蓝筹稳健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,大成蓝筹稳健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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 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年1季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在10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%的交易情形共计1笔,原因为投资策略需要;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在"稳增长"背景下,2015年全年延续实质宽松的"稳健货币政策"。年初以来,中小板和创业板表现抢眼,创业板指、中小板指、上证综指、沪深300涨幅分别为58.67%、46.60%、15.87%、14.64%,上涨个股占比超过九成,体现了A股市场个股普涨的牛市格局,A股市场赚钱效应显著。

本基金在报告期内积极对持仓结构和品种进行调整,适应宏观经济和政策调控节奏,注重风格板块持仓的切换。一方面,在符合经济转型和模式改革方向的军工、新能源、计算机、高端智能装备等行业中精选个股;另一方面,增加对国资改革、环保、"互联网+"等主题板块的配置比例。

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0.9118元,本报告期基金份额净值增长率为24.67%,同期业绩比较基准收益率为9.88%,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

2015年中国经济面临的内外部环境仍错综复杂,不确定性依然存在,但宏观调控政策仍有空间,一方面,通过存量债务置换化解地方政府债务风险,并通过市政债、PPP等市场化模式实现地方政府投资多元化。另一方面,房地产调控政策进一步放松有助于房地产资金链风险的缓释。

宏观经济企稳、市场风险偏好提升、流动性相对宽松以及资本市场改革预期强化与推进,将构成二季度A股市场上行的基本驱动力。基于以上判断,股指继续走牛的概率较大。且随着退市制度的实质推进,注册制的深入,绩优蓝筹板块和个股将获得市场的青睐。本组合将继续顺应市场趋势,保持汽车、金融等稳定行业的配置比例,结合宏观经济的波动节奏,捕捉国防军工、工业自动化、互联网金融和传媒行业改革等新兴领域的投资机会,通过自下而上精选优质标的,实现超额收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,771,584,132.77	92.95
	其中:股票	8,771,584,132.77	92.95
2	固定收益投资	330,096,000.00	3.50
	其中:债券	330,096,000.00	3.50
	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	240,465,946.38	2.55
7	其他资产	95,172,519.34	1.01
8	合计	9,437,318,598.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	4,814,587,347.46	51.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	430,106,187.60	4.58
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	465,195,266.82	4.96
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	825,642,323.40	8.80
J	金融业	1,706,643,666.46	18.19
K	房地产业	1,956,845.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	-	0.00
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	527,452,496.03	5.62
S	综合	-	0.00
	合计	8,771,584,132.77	93.50

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600741	华域汽车	34,511,028	763,383,939.36	8.14
2	601166	兴业银行	37,812,473	694,237,004.28	7.40
3	300124	汇川技术	16,181,970	675,920,886.90	7.20
4	000625	长安汽车	28,991,103	669,404,568.27	7.14
5	600271	航天信息	12,030,989	625,130,188.44	6.66
6	600705	中航资本	23,185,862	554,142,101.80	5.91
7	000768	中航飞机	19,460,516	528,547,614.56	5.63
8	600759	洲际油气	33,371,253	465,195,266.82	4.96
9	601555	东吴证券	20,002,818	458,264,560.38	4.88
10	600549	厦门钨业	11,973,431	457,744,267.13	4.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	330,096,000.00	3.52
	其中:政策性金融债	330,096,000.00	3.52
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	330,096,000.00	3.52

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140443	14农发43	1,000,000	100,060,000.00	1.07
2	120407	12农发07	1,000,000	99,960,000.00	1.07
3	140212	14国开12	600,000	60,012,000.00	0.64
4	140223	14国开23	500,000	50,050,000.00	0.53
5	140357	14进出57	200,000	20,014,000.00	0.21

5.6 报告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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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。

5.11.2 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备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	754,439.62
2	应收证券清算款	77,855,218.19
3	应收股利	-
4	应收利息	10,129,042.60
5	应收申购款	6,433,818.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,172,519.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600741	华域汽车	763,383,939.36	8.14	重大事项停牌
2	000625	长安汽车	669,404,568.27	7.14	重大事项停牌
3	600271	航天信息	625,130,188.44	6.66	重大事项停牌
4	600759	洲际油气	465,195,266.82	4.96	重大事项停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,270,411,660.41
报告期期间基金总申购份额	78,109,089.05
减:报告期期间基金总赎回份额	1,059,844,667.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	10,288,676,082.24

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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