大成现金增利货币市场基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成现金增利货币	
交易代码	090022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月20日	
报告期末基金份额总额	4,275,615,589.60份	
投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下,争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。	
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	银行活期存款利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金,混合型基金、债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	090022	091022
报告期末下属分级基金的份额总额	4,118,654,271.43份	156,961,318.17份

§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4月1日 - 2015年6月30日)	
	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
1. 本期已实现收益	48,400,255.48	5,485,954.99
2.本期利润	48,400,255.48	5,485,954.99
3.期末基金资产净值	4,118,654,271.43	156,961,318.17

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

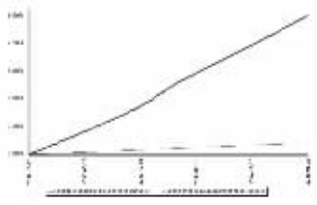
大成现金增利货币A

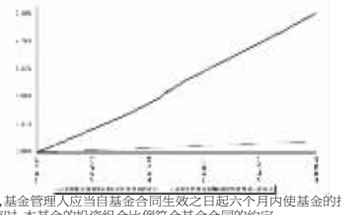
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0849%	0.0059%	0.0873%	0.0000%	0.9976%	0.0059%

大成现金增利货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1457%	0.0059%	0.0873%	0.0000%	1.0584%	0.0059%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
李达夫先生	本基金基金经理	2013年3月7日	-	9年	数量经济学硕士。2006年7月至2008年4月就职于东莞农商银行资金营运中心,历任交易员、研究员。2008年4月至2012年9月就职于国投瑞银基金管理有限公司固定收益部,2011年6月30日至2012年9月15日担任国投瑞银货币市场基金基金经理。2012年9月加入大成基金管理有限公司。2013年3月7日至2014年4月4日任大成货币市场证券投资基金基金经理。2013年3月7日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景安短融债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成信用增利一年定期开放债券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》、《大成现金增利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成现金增利货币市场基金的投资范围、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 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2季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在30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,但不存在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;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易;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年二季度,经济增长底部徘徊,4、5月工业增加值同比增速仅在6%附近。受油价及猪价反弹影响,CPI略有上行,但同比涨幅仍在1.5%以下。二季度货币政策取向发生了较大转变,央行先后下调了公开市场逆回购利率,下调存款准备金一个百分点,降息两次。银行间回购利率快速下行,二季度隔夜回购利率均值仅为1.54%,7天2.5%,创5年来新低。

二季度资金环境整体保持宽松,各类货币市场利率出现快速下行。1年期金融债收益率下行120bp,各评级短融收益率下行超过130bp,1-3个月shibor利率报价下行超过150bp,同业存款报价多为减点。

二季度,本组合降低中高评级短融投资比例,提高逆回购以及存款投资比例以应对IPOs带来的流动性冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类净值收益率为1.0849%,B类净值收益率1.1457%,期间业绩比较基准收益率为0.0873%。

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2015年三季度,经济面临的下行压力仍然较大,股市快速去杠杆引发剧烈调整,市场风险偏好快速下降,资金配置需求重新回流债券市场。本基金在三季度将密切关注金融市场的变化,在稳健操作的原则下,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。基于市场基本面和资金面的判断,本基金将继续保持投资组合的高流动性,在控制流动性风险的前提下,利用短期融资券作为收益增强工具提高组合收益。在具体投资品种上,本基金投资将以存款、短期融资券为主,尽量利用资金面波动对收益率造成的影响获得交易性机会。

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	固定收益投资	2,039,960,937.69	45.56
	其中:债券	2,039,960,937.69	45.56
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	912,564,866.34	20.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,062,764,418.39	23.74
4	其他资产	461,917,089.17	10.32
5	合计	4,477,207,311.59	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.60	
	其中,买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	197,999,781.00	4.63
	其中,买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过90天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	53.21	4.63
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	3.74	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	9.60	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	6.32	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	21.04	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		93.91	4.63

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	摊余成本(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	410,225,292.85	9.59
	其中:政策性金融债	410,225,292.85	9.59
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	1,629,735,644.84	38.12
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	2,039,960,937.69	47.71
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	2,000,000	200,367,741.46	4.69
2	041554026	15国电集CP002	1,000,000	99,981,843.11	2.34
3	130215	13国开15	1,000,000	99,696,157.43	2.33
4	041456042	14泰三核CP001	500,000	50,094,636.64	1.17
5	100230	10国开30	500,000	50,046,927.34	1.17
6	011590005	15苏交通SCP005	500,000	50,000,160.62	1.17
7	071516004	15华泰证券CP004	500,000	49,999,234.41	1.17
8	041459054	14九州通CP002	500,000	49,996,298.35	1.17
9	011548001	15中节能SCP001	500,000	49,987,071.95	1.17
10	011599203	15鲁高速投SCP001	500,000	49,987,021.63	1.17

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	49
报告期内偏离度的最高值	0.4782%
报告期内偏离度的最低值	0.1597%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3261%

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	31,008,767.12
4	应收申购款	430,908,322.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	461,917,089.17

5.8.5 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

项目	大成现金增利货币A	大成现金增利货币B
报告期期初基金份额总额	5,651,012,398.41	719,772,375.90
报告期期间基金总申购份额	15,158,478,975.36	313,953,614.15
减:报告期期间基金总赎回份额	16,690,837,102.34	876,764,671.88
报告期期末基金份额总额	4,118,654,271.43	156,961,318.17

§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。

2、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。

§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现金增利货币市场基金的文件;

2、《大成现金增利货币市场基金合同》;

3、《大成现金增利货币市场基金托管协议》;

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7月21日

大成蓝筹稳健证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月21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7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4月1日起至6月30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	5,300,505,811.63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)采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%+中信标普国债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	2,659,351,358.02
2.本期利润	1,506,059,615.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.1877
4.期末基金资产净值	5,341,502,022.57
5.期末基金份额净值	1.0077

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。

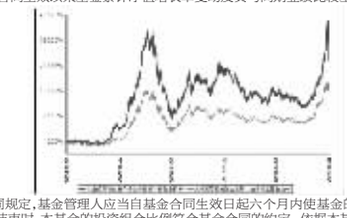
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.52%	3.16%	7.98%	1.82%	2.54%	1.34%

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:1、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。

2、截至报告期末,本基金投资的奥飞动漫(002292)因筹划重大事项停牌,导致投资比例被动超标。除此之外,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。

§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		
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。2015年5月23日起任大成行业轮动股票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 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2季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在30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,但不存在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;投资组合间债券交易存在1笔同日反向交易;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"。在4月底稳增长政策以及相关配套货币宽松政策下,二季度经济改善一度较为明显。特别是房地产销量的持续回升,以及电厂煤耗的转好等成为令人关注的"亮点"。不过,企稳力度依然是弱势,6月下行压力再度加大,显示经济企稳并不稳固。

本基金在报告期内积极对于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、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、传媒、"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1.0077元,本报告期基金份额净值增长率为10.52%,同期业绩比较基准收益率为7.98%,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,但货币政策宽松格局不变。4、5月份数据显示的经济弱企稳状态并不稳固,考虑到6月宏观数据又会显现疲态,3季度政策宽松格局仍将延续。未来宽松政策将更多向刺激实体经济流动性方面倾斜,通过PSL、地方政府债务扩容、降低企业债发行标准以及放松房地产开发贷款条件等方式引导资金进入实体经济,刺激社会融资总量增长。

下半年中国宏观经济增长能够保持平稳,经济转型继续推进,流动性相对宽松以及资本市场改革预期强化与推进,将构成三季度A股市场的基本驱动力。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	4,972,065,355.81	91.05
	其中:股票	4,972,065,355.81	91.05
2	固定收益投资	32,651,157.00	0.60
	其中:债券	32,651,157.00	0.60
	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	352,302,597.54	6.45
7	其他资产	103,777,211.10	1.90
8	合计	5,460,796,321.45	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	3,381,435,448.99	63.30
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	669,836,224.28	12.54
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	459,895,193.24	8.61
J	金融业	460,898,489.30	8.63
K	房地产业	-	0.00
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	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	4,972,065,355.81	93.08

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	002292	奥飞动漫	19,159,634	714,462,751.86	13.38
2	000768	中航飞机	11,901,134	518,651,419.72	9.71
3	300124	汇川技术	10,502,825	504,135,600.00	9.44
4	600271	航天信息	7,576,408	490,269,361.68	9.18
5	600705	中航资本	19,909,222	460,898,489.30	8.63
6	000625	长安汽车	21,160,303	447,540,408.45	8.38
7	600998	九州通	19,860,351	444,077,448.36	8.31
8	600741	华域汽车	19,845,984	423,711,758.40	7.93
9	002702	海欣食品	10,846,623	282,662,995.38	5.29
10	300212	易华录	3,787,142	242,831,545.04	4.55

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	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
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	32,651,157.00	0.61
8	其他	-	0.00
9	合计	32,651,157.00	0.61

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	110031	航信转债	224,700	32,651,157.00	0.61

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期未未持有权证。

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

本基金本报告期未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,800,455.52
2	应收证券清算款	95,256,843.98
3	应收股利	-
4	应收利息	78,651.49
5	应收申购款	3,641,260.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,777,211.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未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	002292	奥飞动漫	714,462,751.86	13.38	重大事项停牌
2	002702	海欣食品	282,662,995.38	5.29	重大事项停牌
3	300212	易华录	242,831,545.04	4.55	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	10,288,676,082.24
报告期期间基金总申购份额	284,364,230.17
减:报告期期间基金总赎回份额	5,272,534,500.78
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	5,300,505,811.63

§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。

2、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。

§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蓝筹稳健证券投资基金的文件;

2、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》;

3、《大成蓝筹稳健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7月21日

大成可转债增强债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月21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7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