大成丰财宝货币市场基金

【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	大成丰财宝货币	
交易代码	000626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月18日	
报告期末基金份额总额	185,745,153.15份	
投资目标	在有效控制投资组合风险,保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
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	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
下属分级基金的交易代码	000626	000627
报告期末下属分级基金的份额总额	103,059,276.71份	82,685,876.44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)	
	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
1. 本期已实现收益	1,569,177.26	831,170.06
2.本期利润	1,569,177.26	831,170.06
3.期末基金资产净值	103,059,276.71	82,685,876.44

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,由于本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

大成丰财宝货币A

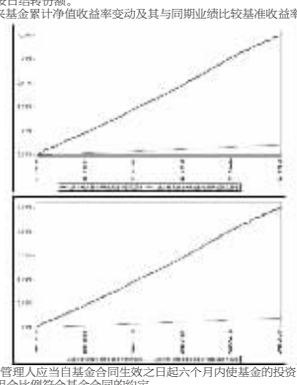
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9378%	0.0074%	0.0873%	0.0000%	0.8505%	0.0074%

大成丰财宝货币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	0.9986%	0.0074%	0.0873%	0.0000%	0.9113%	0.0074%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

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		
邵伟南先生	本基金基金经理	2014年6月18日	2015年6月30日	13年	工商管理硕士。曾任职于郑州纺织工学院、融通基金管理有限公司。2006年3月加入大成基金管理有限公司,历任基金会计、固定收益研究员、基金经理助理。2013年2月1日至2014年9月11日任大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金经理。2013年3月27日至2015年6月30日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2013年11月19日至2015年5月25日任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2014年6月18日至2015年6月30日任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2014年7月28日至2015年6月30日任大成添利宝货币市场基金基金经理。2014年9月12日至2015年6月30日任大成月月盈短期理财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
黄海峰先生	本基金基金经理	2014年12月24日	-	11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日起大成获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日起任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日起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,任大成景耀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》、《大成丰财宝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,大成丰财宝货币市场基金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年二季度债券市场表现较好,受益于经济基本面疲软、央行货币政策放松及银行间回购利率大幅下行,各债券品种均有不错表现,尤以中短端下行幅度最大。整体上看,中债综合财富总指数上涨2.35%。

操作上,本组合根据组合规模、资金面变化和新股申购等时点性冲击影响,在保证流动性基础上,稳步增加优质信用债配置,获取资本利得收益,同时优化组合久期,提高组合静态收益,为持有人创造了一定的持有期回报。

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0.9378%,B类净值收益率0.9986%,期间业绩比较基准收益率为0.0873%。本基金着眼于货币基金流动性管理的本义,在投资管理过程中始终贯彻稳健操作的原则,合理安排投资组合和期限结构,在保证流动性的前提下通过积极主动管理提高组合投资收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们对债券市场保持乐观。稳增长、调结构和经济转型仍然是经济主基调,在消化过剩产能和房地产周期下滑拖累下,经济下行压力较大,新的经济增长点虽然有所苗头,但对冲经济下滑特征稚嫩,预计货币政策仍需要保持流动性宽松格局。短期看,经济复苏乏力,原油等大宗商品低位运行,资本市场大幅回调震荡,这些都是对债券比较有利的。整体看,我们仍然看好债券市场表现。

三季度,我们将进一步加大市场投研力作,逐步提高组合久期,利用时点上模模和收益波动因素,提高波段操作力度,增加组合操作灵活性,优化组合信用敞口,集中配置高评级债券,在降低信用风险前提下增强组合收益。

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	固定收益投资	79,983,298.66	40.39
	其中:债券	79,983,298.66	40.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,635.00	25.25
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	65,844,722.07	33.25
4	其他资产	2,184,745.91	1.10
5	合计	198,013,401.64	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		12.56
	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	11,879,874.06	6.40
	其中:买断式回购融资	-	-

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

本基金合同约定:"除发生巨额赎回的情况外,本基金债券正回购的资产余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个交易日内进行调整"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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120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	48.91	6.40
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	10.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	5.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	16.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.43	6.40

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,966,608.45	10.75
	其中:政策性金融债	19,966,608.45	10.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,016,690.21	32.31
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	79,983,298.66	43.06
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	041460078	14津政投CP001	200,000	20,039,991.51	10.79
2	041471005	14万联能源CP001	100,000	10,007,784.28	5.39
3	041558028	15金域CP001	100,000	9,996,399.13	5.38
4	041471009	14南新工CP001	100,000	9,989,613.09	5.38
5	100225	10国开25	100,000	9,987,819.19	5.38
6	041564033	15张资产CP001	100,000	9,982,902.20	5.37
7	150403	15农发03	100,000	9,978,789.26	5.37

注:主要受基金规模变动影响,报告期末本基金持有14津政投CP001的投资比例超过净值的10%,本基金已按法规及合同要求,在10个交易日内进行了调整。

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	29
报告期内偏离度的最高值	0.3510%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2232%

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

本基金本报告期末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,因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摊益。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	2,053,190.29
4	应收申购款	131,555.62
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,184,745.91

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	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
报告期期初基金份额总额	167,713,150.15	68,666,653.83
报告期间基金总申购份额	230,364,040.01	40,859,280.11
减:报告期期间基金总赎回份额	295,017,913.45	26,840,057.50
报告期期末基金份额总额	103,059,276.71	82,685,876.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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招财宝货币市场基金的文件;

2、《大成丰财宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成丰财宝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

大成高新技术产业股票型证券投资基金

【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	大成高新技术产业股票
交易代码	000628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月3日
报告期末基金份额总额	200,778,318.28份
投资目标	本基金主要投资于高新技术产业相关上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	(一)大类资产配置。本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。(二)股票投资策略。本基金将采取"自下而上"的方式,依靠定量与定性相结合的方法进行个股选择。(三)股指期货投资策略。本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。(四)其它投资策略。由于流动性管理及策略性投资的需要,本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等,由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议,经固定收益投资团队讨论,并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于高新技术产业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。
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

§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	82,137,280.15
2.本期利润	72,593,917.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.1799
4.期末基金资产净值	225,874,305.46
5.期末基金份额净值	1.125

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。

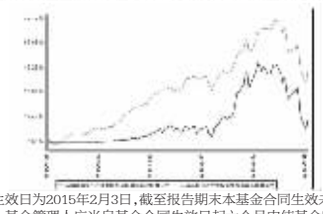
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.01%	3.00%	15.68%	2.31%	-6.67%	0.69%

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、本基金合同生效日为2015年2月3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。截至报告期末,本基金仍在建仓期。

3、截至报告期末,本基金投资的康尼机电(603111)因重大资产重组事项停牌,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		
徐彦先生	本基金基金经理	2015年2月3日	-	9年	管理学硕士。曾就职于中国东方资产管理公司投资管理部,2007年加入大成基金研究部,曾任中游制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日曾任景荣证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理助理。2012年10月31日起任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2014年4月25日起兼任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2015年2月3日起任大成高新技术产业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》、《大成高新技术产业股票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,大成高新技术产业股票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

报告期内的市场比想象的更疯狂,不少公司在转型的大帽子下以匪夷所思的方式上涨到百亿市值并且被认为只是上涨的开始;市场知道其中存在泡沫,但几乎一致认同在新经济下这种泡沫是合理的。本基金在三月份开始建仓时主要买入了一些传统行业转型升级的股票,他们的估值偏贵,但还在可以接受的范围内。

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1.125元,本报告期基金份额净值增长率为9.01%,同期业绩比较基准收益率为15.68%,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

经济转型升级的主线不会改变,资金杠杆对市场的短期影响巨大,但市场可能放大了它的长期影响,很多小而美的公司渐渐进入价值区间。经过过去三年,尤其是过去大半年,我更坚定了自己的投资理念:以判断企业价值为出发点,研究行业趋势、商业模式和管理团队,摒弃相对排名的想法,在显著低估或高估时坚定自己的信念。我相信,在当前价位买入持有和经济转型升级密切相关的优秀公司,能为持有人创造长期稳定的回报。

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	193,278,194.83	76.87
	其中:股票	193,278,194.83	76.87
2	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	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	41,232,623.68	16.40
7	其他资产	16,924,589.75	6.73
8	合计	251,435,408.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,903,578.05	2.61
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	148,490,388.78	65.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	1,160,862.00	0.51
F	批发和零售业	10,688,431.00	4.73
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	9,095,356.00	4.03
J	金融业	8,690,757.00	3.85
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	2,464,320.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	6,784,502.00	3.00
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	193,278,194.83	85.57

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	603111	康尼机电	927,417	33,748,704.63	14.94
2	002271	东方雨虹	643,477	16,537,358.90	7.32
3	002588	史丹利	574,004	16,502,615.00	7.31
4	600703	三安光电	481,297	15,064,596.10	6.67
5	002475	立讯精密	308,495	10,430,215.95	4.62
6	000333	美的集团	273,826	10,208,233.28	4.52
7	600804	XD鹏博士	304,600	9,095,356.00	4.03
8	601166	兴业银行	503,812	8,690,757.00	3.85
9	601933	永辉超市	714,700	8,283,373.00	3.67
10	000625	长安汽车	370,300	7,831,845.00	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

本基金可以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内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	146,051.65
2	应收证券清算款	16,363,236.83
3	应收股利	-
4	应收利息	4,503.87
5	应收申购款	410,797.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,924,589.75

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	603111	康尼机电	33,748,704.63	14.94	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	823,386,466.83
报告期期间基金总申购份额	123,712,275.37
减:报告期期间基金总赎回份额	746,320,423.92
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	200,778,318.28

§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

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

基金管理人未持有基金份额。

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高新技术产业股票型证券投资基金的文件;

2、《大成高新技术产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《大成高新技术产业股票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

大成核心双动力股票型证券投资基金

【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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称