大成灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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	大成灵活配置混合
交易代码	000587
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
报告期末基金份额总额	357,607,716.50份
投资目标	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,在精选个股、个券的基础上适度集中投资,在控制风险的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,综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极、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	年化收益率6%
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高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。
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	156,967,366.65
2.本期利润	93,785,872.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.2460
4.期末基金资产净值	857,987,303.61
5.期末基金份额净值	2.399

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。

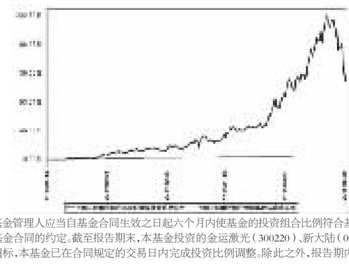
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	28.36%	3.61%	1.42%	0.01%	26.94%	3.60%

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累计收益率变动的比较



注:按本基金合同规定,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,本基金投资的金运激光(300220)、新大陆(000997)因市场行情波动剧烈,导致单个股票的投资比例被动超标,本基金已在合同规定的交易日内完成投资比例调整。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。

§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	任职日期		
李本刚先生	本基金基金经理	2014年5月14日	2015年5月25日	14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日起任大成内需增长股票型证券投资基金基金经理。2014年4月16日起任大成消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014年5月14日至2015年5月25日任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任股票投资部价值组投资总监。具有基金从业资格。国籍:中国
焦巍先生	本基金基金经理、股票投资部总监、首席投资官	2015年3月28日	–	15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,现任公司首席投资官兼股票投资部总监。2015年3月28日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理及大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理。2015年5月26日起任大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 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

经过漫长的调整后,2014年下半年开始,市场开始积蓄做多力量,特别是在2014年10月的降息之后,市场以金融、地产、一路一带等蓝筹价值股为龙头,走出一波比较流畅的行情,年底沪指报收3234点,离2009年的高点3478只有一步之遥;与此同时,创业板受到一定压制,9月之后一直处于横盘整理阶段。2015年年初,对于我们而言是一段比较纠结的时候,蓝筹股能否延续前期的强势?新兴产业龙头能否走出颓势?基于以下三点的考虑,我们最终选择加大对新兴产业龙头的配置。

1) 市场已经活跃,后市走强的概率很大。首先,货币政策进一步宽松的趋势没有结束。一方面整体的经济稳增长压力较大,另一方面CPI、PPI都比较低,为政策的进一步放松释放了空间。另外,资本市场成为经济调结构、产业转型升级的重要抓手,政府对资本市场的重视程度大大增加,建设一个稳定健康的资本市场成为各方的共识,政策友好度大大增加。最后,随着中央反腐的深化,以及各项改革措施的推进,老百姓对国家未来越来越有信心。综上,我们认为股市走强的概率很大。

2) 传统产业还处在底部,以互联网+为代表的新兴产业是新时代的成长股。一季度的中观数据都比较疲弱,地产销售的同环比均出现负增长,整个地产产业链上的钢铁、水泥、煤炭等的价格均出现下跌。与之相对应,以互联网金融和互联网医疗为代表的互联网公司的业绩出现较快增长。当前,移动互联网已经深深融入日常的生活,改变了大家的出行和消费习惯,未来移动互联网将和生产制造紧密结合,提高中国制造的效率。

3) 从历史经验看,成长股是每一轮牛市的龙头。07年的牛市中,得益于中国经济和贸易的高速增长,地产,造船,钢铁等行业迎来快速发展阶段,他们是当时的成长股代表,新时代的成长股将以互联网和工业4.0为代表。

五月之后,从市场表现来看,"成长派"明显占据上风,创业板和中小板的估值也泡沫化,开户人数和杠杆资金不断创新高,整个市场出现过热的迹象,政策调控的力度增大。六月开始的多项措施中,清理场外违规杠杆资金逐渐成为市场主角,这一因素最开始引发A股出现较大跌幅,随着跌幅加深,一些趋势投资者出于对杠杆资金爆仓的担忧,开始恐慌性减仓,到目前为止,这一过程仍然在继续演进,其持续时间和猛烈程度远远超出我们的预期。

总结来看,上半年我们对市场走势和行业配置上有一些成功的地方,也取得了一定的成绩,但是,在六月最后的两个星期中,由于对本轮回调可能产生的幅度估计不足,在仓位上没有做好足够的应对,导致前期浮盈被大幅度回撤。历史上,A股还没有出现像本轮那么多的杠杆资金参与,而本次急速的调整由去杠杆导致,其中很多经验和教训需要我们用更长的时间去总结。

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2.399元,本报告期基金份额净值增长率为28.36%,同期业绩比较基准收益率为1.42%,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

首先,我认为牛市的大格局没有变化,市场走强的根本动力依然存在(货币宽松、经济转型、政策支持),目前的一轮调整依然是调整,不过恐慌蔓延的修复需要一定的时间。从国内外历史经验来看,在牛市后期往往会出现货币政策收紧。未来可能导致货币政策收紧(或不再放松)的主要因素来自于:经济企稳复苏、通胀上行、全国性的房价上涨,可以把这三个因素作为货币政策收紧的领先信号。

风格与行业方面,我们认为传统行业的估值修复将逐渐结束,寻找新兴行业中的龙头,同时兼顾业绩增速和估值,也就是寻找创蓝筹(创业板中的蓝筹股),总体而言,资金将进一步向成长龙头集聚。我们预计在今年下半年传统行业盈利将逐步见底并弱回升。2015年传统行业盈利改善的动力一:地产产业链的小周期复苏。地产产业链是国内最庞大的一条产业链,也是A股传统行业的核心组成部分。而最近半年,地产盈利已出现见底回升趋势,而A股整体盈利还在下滑中,我们认为一旦地产的景气回升向其中上游传递,很快也就能够看到A股整体的盈利回升。2015年传统行业盈利改善的动力二:资源类行业景气的见底回升。今年一季报A股盈利大幅下滑,罪魁祸首就是上游资源类行业。在A股以往的周期中,资源类行业的盈利趋势与A股整体是差不多的。但在本轮周期中,资源类行业盈利增速明显低于A股整体,而其2015年一季报增速只有-75%,这对A股整体的业绩形成了很大的压制。尽管地产和资源类行业的盈利有可能在三季度后见底回升,但其估值水平将面临压力,空间有限。每一轮牛市中,真正能够"泡沫化"的股票,并不在于其市值大小,而在其所处行业迎合了当时的大时代背景,是大时代下的"成长股"。以科技和互联网为代表的新兴成长行业将可能在本轮牛市中实现真正的"泡沫化",但在这一轮深幅的调整下,资金的风险结构发生重大变化,风险偏好高的一批资金遭受重创,市场参与者的整体风险偏好下降,未来我们的选股将兼具行业发展空间,公司竞争力和卡位优势,业绩和估值这三方面,投资主线是"寻找新蓝筹",适度降低组合的估值水平。

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	777,952,384.57	83.84
	其中:股票	777,952,384.57	83.84
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	100,896,680.37	10.87
7	其他资产	49,003,841.40	5.28
8	合计	927,852,906.34	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	430,271,690.74	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	82,811,521.26	9.65
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	264,853,721.27	30.87
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	582.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	8,564.98	0.00
R	文化、体育和娱乐业	6,304.12	0.00
S	综合	–	–
	合计	777,952,384.57	90.67

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	300220	金运激光	1,666,865	90,677,456.00	10.57
2	000997	新大陆	3,264,998	86,848,946.80	10.12
3	300353	东土科技	1,456,733	84,199,167.40	9.81
4	600682	南京新百	2,206,542	82,811,521.26	9.65
5	603019	中科曙光	900,582	77,981,395.38	9.09
6	600588	用友网络	1,430,766	65,643,544.08	7.65
7	002268	卫士通	700,043	56,101,446.02	6.54
8	002651	利君股份	1,013,616	43,788,211.20	5.10
9	002605	姚记扑克	1,958,000	41,627,080.00	4.85
10	603898	好莱客	347,008	37,986,965.76	4.43

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险,如预期大额申购赎回、大量分红等。

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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	747,059.19
2	应收证券清算款	44,619,877.64
3	应收股利	–
4	应收利息	23,285.43
5	应收申购款	3,613,619.14
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	49,003,841.40

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	300353	东土科技	84,199,167.40	9.81	重大资产重组
2	002268	卫士通	56,101,446.02	6.54	重大事项
3	002605	姚记扑克	41,627,080.00	4.85	重大事项
4	603898	好莱客	37,986,965.76	4.43	重大事项

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	190,330,408.68
报告期期间基金总申购份额	740,398,891.75
减:报告期期间基金总赎回份额	573,121,583.93
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	357,607,716.50

§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灵活配置混合型证券投资基金的文件;
2、《大成灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《大成灵活配置混合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

大成蓝筹稳健证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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)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。

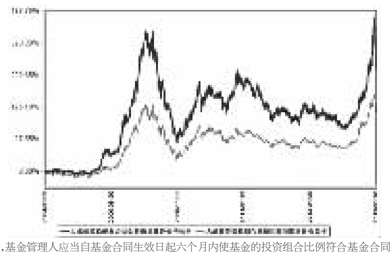
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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		
支兆华先生	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

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	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

大成高新技术产业股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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。

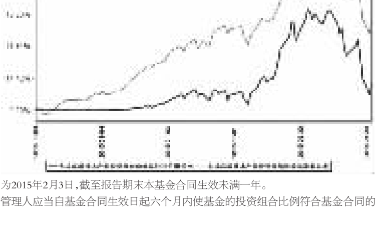
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	任职日期		
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日曾任景宏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

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

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	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的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

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