大成精选增值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	大成精选增值混合
交易代码	090004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年12月15日
报告期末基金份额总额	1,188,190,522.56份
投资目标	投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业,为投资者寻求持续稳定的投资收益。
投资策略	本基金利用大成基金自行开发的投资管理流程,采用"自上而下"资产配置和行业配置,"自下而上"精选股票的投资策略,主要投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票,通过积极主动的投资策略,追求基金资产长期的资本增值。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+中国债券总指数×25%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,由于本基金采取积极的投资管理、主动的行业配置,使得本基金成为证券投资基金中风险程度中等偏高的基金产品,其长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。
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	700,918,882.51
2.本期利润	456,873,128.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.3351
4.期末基金资产净值	1,838,808,815.51
5.期末基金份额净值	1.5476

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。

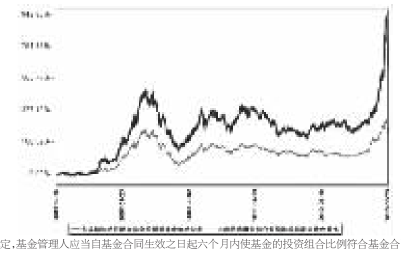
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	25.36%	3.02%	8.75%	1.96%	16.61%	1.06%

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。

2、大成基金管理有限公司根据《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2011年1月1日起,大成精选增值混合型证券投资基金使用的业绩比较基准由原 "新华富时中国A600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%" 变更为 "沪深300指数×75%+中国债券总指数×25%"。

§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		
刘安田先生	本基金基金经理	2010年4月7日	2015年4月6日	11年	金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金,历任大成基金管理有限公司研究部总监助理、股票投资部混合组投资总监。2012年3月20日至2013年7月17日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。2013年3月8日至2014年4月9日任景宏证券投资基金基金经理。2010年4月7日至2015年4月6日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2014年4月10日至2015年4月6日任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
魏庆国先生	本基金基金经理	2015年4月7日	-	6年	经济学硕士。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员;2012年至2013年任职于平安大华基金研究部;2013年5月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日起担任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理及大成精选增值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》、《大成精选增值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,大成精选增值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

2015年2季度,海外市场总体处于高位震荡,道指下跌0.88%,纳指上涨0.1%,英国富时100下跌3.72%,法国CAC40指数下跌4.48%,德国DAX指数下跌8.53%。欧元区的经济继续缓慢回升,但债券收益率在前期大幅下跌后出现了明显的超跌反弹,希腊退欧危机再现,成为市场关注的焦点;美国经济依然比较平稳,就业继续恢复,美元在冲高后出现回落,总体也呈现高位盘整状态,但我们判断,美国经济目前仍然比较健康,继续复苏的态势没有改变。

国内经济在2015年2季度没有太大起色,工业数据表现依然低迷,但地产销售在逐步回升,货币政策也持续宽松,预计在3季度或4季度中国经济将逐步企稳回升。而在2季度,中国政府继续出台一系列稳增长政策,包括宽货币、增加项目的投入、积极推动互联网的发展,相信在下半年我们会逐步看到这些政策的效果。A股在2季度的冲高回落,社会资金入市在2季度初期推动市场上涨,但6月份由于新股发行导致资金面收紧造成市场出现大幅度下跌,上证指数上涨14.2%,沪深300上涨10.41%,创业板指上涨22.42%,中小板指上涨15.32%。

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1.5476元,本报告期基金份额净值增长率为25.36%,同期业绩比较基准收益率为8.75%,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2015年3季度,我们认为中国经济在货币放松以及一系列政策的配合下,将会逐步企稳回升,这为中国经济转型提供稳定的宏观基础。我们认为A股在3季度仍有比较好的投资机会,但个股会较上半年分化,市场流动性也不会如上半年充裕。我们会重点研究一下领域的投资机会:(1)互联网在中国经济的影响力已经逐步增强,为中国经济的发展注入了活力,因此,移动互联网、产业互联网、互联网金融是我们长期看好的投资方向;(2)政府加大刺激力度的领域,如"一带一路"、房地产、"京津冀"等;(3)强周期行业如地产、证券、保险等应该有阶段性的投资机会。

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	权益投资	1,733,731,736.29	90.94
	其中:股票	1,733,731,736.29	90.94
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	40,148,000.00	2.11
	其中:债券	40,148,000.00	2.11
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	127,794,710.70	6.70
8	其他资产	4,791,473.09	0.25
9	合计	1,906,465,920.08	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	1,024,694,464.85	55.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,297,859.36	3.55
E	建筑业	432.40	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	201,115,216.36	10.94
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,216,210.00	4.53
J	金融业	569.25	0.00
K	房地产业	85,221,187.23	4.63
L	租赁和商务服务业	133,640,335.78	7.27
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	140,545,461.06	7.64
S	综合	-	0.00
	合计	1,733,731,736.29	94.29

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	000861	海印股份	6,218,722	133,640,335.78	7.27
2	002239	金飞达	7,238,434	123,198,146.68	6.70
3	000089	深圳机场	10,806,246	121,894,454.88	6.63
4	002235	安妮股份	3,882,117	115,881,192.45	6.30
5	300007	汉威电子	1,565,785	111,593,496.95	6.07
6	300068	南都电源	5,348,097	111,507,822.45	6.06
7	600185	格力地产	2,642,472	85,219,722.00	4.63
8	000503	海虹控股	1,698,290	83,216,210.00	4.53
9	000925	众合科技	2,871,615	79,256,574.00	4.31
10	600897	厦门空港	2,588,068	79,220,761.48	4.31

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	40,148,000.00	2.18
	其中:政策性金融债	40,148,000.00	2.18
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	40,148,000.00	2.18

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	140357	14进出57	400,000	40,148,000.00	2.18

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	1,569,984.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,405,370.21
5	应收申购款	1,816,117.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,791,473.09

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	002239	金飞达	123,198,146.68	6.70	重大事项停牌
2	300007	汉威电子	111,593,496.95	6.07	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	1,585,311,232.41
报告期期间基金总申购份额	264,498,608.16
减:报告期期间基金总赎回份额	661,619,318.01
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	1,188,190,522.56

§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精选增值混合型证券投资基金的文件;
2、《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》;
3、《大成精选增值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

大成景丰债券型证券投资基金(LOF)

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20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	大成景丰债券(LOF)
场内简称	大成景丰
交易代码	160915
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年10月15日
报告期末基金份额总额	198,433,424.35份
投资目标	在严格控制投资风险、保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获得高于业绩比较基准的投资业绩,使基金份额持有人获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究和投资管理优势,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,在资产配置、类属配置、个券选择和交易策略层面实施积极管理策略;在严格控制风险的前提下,实现基金组合风险和收益的最优配比。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券基金,风险收益水平高于货币市场基金,低于混合基金和股票基金。
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	21,648,443.17
2.本期利润	16,006,051.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0862
4.期末基金资产净值	293,700,173.05
5.期末基金份额净值	1.480

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。

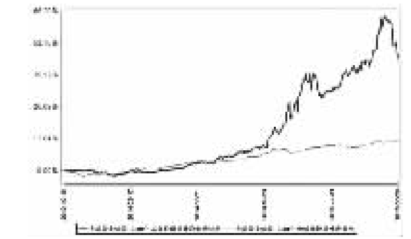
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.17%	1.05%	2.35%	0.10%	3.82%	0.95%

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,基金管理人应当自开放期起始日起三个月内使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	2014年9月3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
王立女士	本基金基金经理	2014年9月3日	-	13年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005年4月加入大成基金管理有限公司,曾任大成货币市场基金基金经理助理。2012年11月20日至2014年4月4日任大成现金增利货币市场基金基金经理。2007年1月12日至2014年12月23日担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009年5月23日起兼任大成债券投资基金基金经理。2013年2月1日至2015年5月25日任大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理。2013年7月23日至2015年5月25日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。现任固定收益总部总监助理。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》、《大成景丰分级债券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,大成景丰债券型证券投资基金(LOF)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年二季度经济仍呈现内外需低迷、通胀处于低位和工业品继续通缩的局面。具体来看,多数工业品价格仍然下跌,工业企业利润未有起色,工业生产仍然低迷。受政府公共财政收入增长乏力、土地出让收入大幅下降和规范地方政府债务的影响,财政收缩效应明显,基建投资面临较大压力。330新政确实带动了房地产销售的回暖,然后从新开工和拿地情况来看,销售对投资拉动的弹性明显不足。金融数据方面,5月较前4个月的大幅萎缩略有改善,但货币增速和社融余额增速仍在下滑,货币疏导不畅,金融有脱实向虚的特征。货币政策整体上延续了宽松,5月降息25bps, 6月末双降,货币市场利率处于年内低位。地方债置换是压制二季度长端收益率下行的主要原因之一,截至6月末,今年已发行地方债8683亿,年内至少还剩余1.1万亿。

具体到市场表现方面,二季度中债综合财富(总值)指数涨幅2.294%。大类资产方面,资金面持续宽松,短端利率下行幅度较大,1年国开下行120bp,5年下行40bp,10年国开仅下行17bp,收益率曲线严重陡峭化。信用债方面,信用利差处于历史地位,二季度仅小幅收窄10bp左右,信用债利率主要受到基准利率带动。

2015年2季度,股票市场出现了剧烈调整,市场整体呈现急跌急涨的态势。总体上看,上证综指季度涨幅为14.12%,创业板指数涨幅为22.42%,沪深300指数涨幅为10.41%。但从6月下旬开始,市场出现了极端的连续跌停,这形成了巨大的下跌压力。由于转债市场同股票市场高度相关,在股票市场季度末暴跌以及溢价率降低的双重影响下,中证转债指数出现了大幅大跌,跌幅为11.46%。其中6月份爆跌了26.81%。

二季度,本基金加仓了部分中长期利率债,在保持的信用债基础投资比例的同时严控信用风险,精选中高等级信用个券以获得较高的持有期回报。权益方面,本产品降低了转债和股票的仓位,但受到市场影响,本产品的净值出现一定幅度波动。

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1.480元,本报告期基金份额净值增长率为6.17%,同期业绩比较基准收益率为2.35%,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

展望三季度,我们将面临更复杂动荡的内外部环境。海外方面,希腊债务危机仍在进行,而美国仍有可能在9月首次加息。国内方面,股市去杠杆还要持续一段时间,低风险资产受益于国内风险偏好下降带来的资产配置调整。同时,也需要进一步观测和关注股市财富效应消失对于居民消费、房地产销售和金融行业是否会产生明显的负面冲击。政府在5月开始加大了稳增长的力度,尤其是财政政策方面,其中较为关键的措施是放松平台融资。不过,在43号文的框架下,平台融资效率不如从前,因此地方政府融资的恢复程度仍待观察。货币政策面临要在稳增长、稳汇率和化解危机之间平衡。从稳增长和恢复企业盈利能力的角度,下半年仍有降准降息的必要。另外,美元指数的攀升和大宗价格的下跌,也令下半年的CPI和PPI的市场预期出现了下修风险。

综上所述,当前环境下货币政策宽松的持续性和力度加强,对债券市场形成有力支撑,股票市场的剧烈波动和新股暂停发行,使得市场资金可能出现配置转移,债券市场存在投资机会。我们认为,由于受到杠杆资金需要持续出清股票的压力,市场将进入一个极度不确定的时期,短期内仍将承担巨大压力,需要密切观察资金的流出速度和国家的政策动向。但同时,我们也认为,由于市场持续暴跌,因此部分个股将逐步显现投资机会

基于以上判断,2015年度三季度本基金继续以资质较好的信用债作为主要配置,利率债采取波段操作。同时我们短期降低权益仓位,控制波动,操作上保持对于权益资产灵活配置,等待市场机会。

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	权益投资	47,722,874.09	13.79
	其中:股票	47,722,874.09	13.79
2	固定收益投资	280,549,536.08	81.04
	其中:债券	280,549,536.08	81.04
	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	9,919,225.09	2.87
7	其他资产	7,974,559.85	2.30
8	合计	346,166,195.11	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	24,750.00	0.01
C	制造业	23,383,784.92	7.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,330.00	0.08
E	建筑业	4,464,379.36	1.52
F	批发和零售业	-	0.00
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	13,722,684.81	4.67
J	金融业	5,856,380.00	1.99
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	22,565.00	0.01
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	47,722,874.09	16.25

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	600050	中国联通	1,259,957	9,235,484.81	3.14
2	300112	万讯自控	300,036	6,621,794.52	2.25
3	600036	招商银行	300,000	5,616,000.00	1.91
4	000651	格力电器	80,000	5,112,000.00	1.74
5	600835	上海机电	150,000	4,941,000.00	1.68
6	300096	易联众	158,000	4,487,200.00	1.53
7	002051	中工国际	149,912	4,464,379.36	1.52
8	002614	蒙发利	150,000	2,674,500.00	0.91
9	000810	创维数字	97,840	2,426,432.00	0.83
10	601989	中国重工	104,008	1,539,318.40	0.52

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	31,536,800.00	10.74
	其中:政策性金融债	31,536,800.00	10.74
4	企业债券	136,695,492.00	46.54
5	企业短期融资券	20,112,000.00	6.85
6	中期票据	72,848,000.00	24.80
7	可转债	19,357,244.08	6.59
8	其他	-	0.00
9	合计	280,549,536.08	95.52

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	101459006	14苏交投MTN001	200,000	21,338,000.00	7.27
2	101454021	14深高速MTN001	200,000	20,380,000.00	6.94
3	011433011	14五矿SCP011	200,000	20,112,000.00	6.85
4	150205	15国开05	200,000	19,494,000.00	6.64
5	113501	洛钼转债	100,000	13,944,000.00	4.75

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	55,088.10
2	应收证券清算款	3,051,287.21
3	应收股利	-
4	应收利息	4,868,184.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,974,559.85

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	113501	洛钼转债	13,944,000.00	4.75
2	128009	歌尔转债	1,745,944.88	0.59

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	300112	万讯自控	6,621,794.52	2.25	重大事项
2	300096	易联众	4,487,200.00	1.53	重大事项

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	215,171,365.55
报告期期间基金总申购份额	136,260,060.57
减:报告期期间基金总赎回份额	152,998,001.77
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	198,433,424.35

§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景丰分级债券型证券投资基金的文件;
2、《大成景丰分级债券型证券投资基金基金合同》;
3、《大成景丰分级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

大成景安短融债券型证券投资基金

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	大成景安短融债券	
交易代码	000128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月24日	
报告期末基金份额总额	485,792,323.65份	
投资目标	在严格控制风险并保持流动性的基础上,主要通过对短期融资券和其他固定收益类证券的积极主动管理,力争超越同期银行定期存款利率、获取绝对回报。	
投资策略	本基金主要目标是在努力保持本金稳妥、高流动性特点的同时,通过适当延长基金投资组合的久期、更高比例的短期融资券以及其它期限较短信用债券的投资,争取获取更高的投资收益。	
业绩比较基准	中债短融总指数	
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B
下属分级基金的交易代码	000128	000129
报告期末下属分级基金的份额总额	77,683,616.93份	408,108,706.72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)	
	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B
1.本期已实现收益	2,055,842.74	10,694,929.65
2.本期利润	2,744,156.51	13,482,793.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0286	0.0283
4.期末基金资产净值	89,130,652.22	471,083,046.05
5.期末基金份额净值	1.147	1.154

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

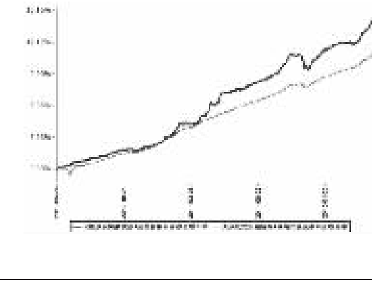
大成景安短融债券A

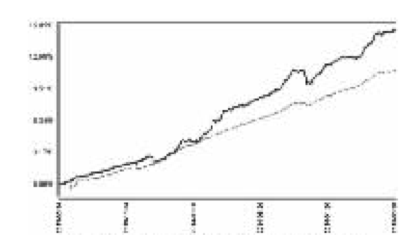
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.50%	0.07%	1.55%	0.03%	0.95%	0.04%

大成景安短融债券B

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	2.58%	0.06%	1.55%	0.03%	1.03%	0.03%

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		
李达夫先生	本基金基金经理	2013年7月17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》、《大成景安短融债券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,大成景安短融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。

市场表现方面,二季度中债综合财富指数上涨2.35%,其中4月份上涨1.51%,5、6月份分别上涨0.61%,0.21%。类属资产方面,在货币政策放松力度明显加大的刺激下,利率债4月份走出了一波快速修复行情,10年期国开债收益率一度下行超过40bp。5、6月份虽然资金利率继续保持在低位,但受到地方债潜在供给的影响,短端利率向中长端的传导并不顺畅。信用债的表现好于利率债,虽然股市火爆使得居民资产配置继续向股权市场倾斜,打新、两融受益权等类固收产品对传统债券需求形成分流,但二季度信用债供给整体维持在低位,资金宽松使得套息策略有效性仍高,中债企业债指数二季度回报达到3.08%,且每个月均为正回报。

二季度,本基金提高了组合的杠杆水平,加大了信用债的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,大成景安短融债券A份额净值增长率为2.5%,大成景安短融债券B份额净值增长率为2.58%,同期业绩比较基准增长率为1.55%,基金份额净值增长率高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

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。虽然平台再融资门槛放松,三季度信用债发行量有望进一步上升,但在资金面整体保持宽松,实体融资需求没有根本恢复的背景下,信用利差扩张的风险有限。7、8月份是负面评级行动的高发期,个券信用风险管理仍是重中之重。

基于以上判断,三季度本基金将以短期信用债为主要配置,维持较高杠杆比例,并适当提高组合久期。

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	-	0.00
	其中:股票	-	0.00
2	固定收益投资	809,609,446.74	96.70
	其中:债券	809,609,446.74	96.70
	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	12,125,667.72	1.45
7	其他资产	15,472,994.51	1.85
8	合计	837,208,108.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	7,117,040.00	1.27
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	30,135,000.00	5.38
	其中:政策性金融债	30,135,000.00	5.38
4	企业债券	294,811,906.74	52.62
5	企业短期融资券	436,849,500.00	77.98
6	中期票据	40,696,000.00	7.26
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	809,609,446.74	144.52

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	041562003	15沪世茂CP001	300,000	30,282,000.00	5.41
2	041552016	15鄂能源股CP001	300,000	30,174,000.00	5.39
3	041572005	15宁技发CP001	300,000	30,159,000.00	5.38
4	041559029	15武国资CP002	300,000	30,039,000.00	5.36
5	041569007	15东方园林CP001	300,000	29,961,000.00	5.35

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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的,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 本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发,本基金无备选股票库,无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,537.11
2	应收证券清算款	999,283.33
3	应收股利	-
4	应收利息	14,017,498.62
5	应收申购款	430,675.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,472,994.51

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

项目	大成景安短融债券A	大成景安短融债券B
报告期期初基金份额总额	143,241,768.09	628,617,957.43
报告期期间基金总申购份额	352,480,663.14	300,718,285.87
减:报告期期间基金总赎回份额	418,038,814.30	521,227,536.58
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	77,683,616.93	408,108,706.72

§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景安短融债券型证券投资基金的文件;
2、《大成景安短融债券型证券投资基金基金合同》;
3、《大成景安短融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