大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

2015 第三季度 报告

2015年9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10月24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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成创新成长混合
场内简称	大成创新
交易代码	160910
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2007年6月12日
报告期末基金份额总额	2,529,248,927.88份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，超越业绩比较基准，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以股票投资为主，采用积极的投资策略，精选具备持续增长能力、价格处于合理区间的优质股票构建投资组合；本基金以固定收益品种投资为辅，确保投资组合具有良好的流动性。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。
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7月1日 — 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	283,856,041.10
2.本期利润	−737,006,277.92
3.加权平均基金份额本期利润	−0.2885
4.期末基金资产净值	2,430,222,076.84
5.期末基金份额净值	0.961

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。

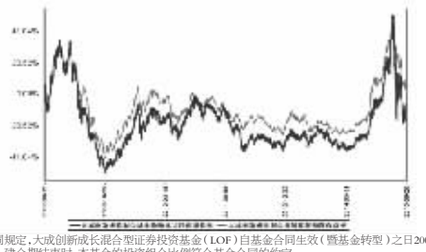
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	−22.75%	3.77%	−19.72%	2.34%	−3.03%	1.43%

3.2.2 自基金转型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：按基金合同规定，大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）自基金合同生效（暨基金转型）之日2007年6月12日起三个月内为建仓期。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		
杨建勋先生	本基金基金经理	2011年4月22日	2015年8月11日	14年	北京大学经济学院经济学硕士，曾任职于沈阳会计师事务所、鹏华基金管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司。2004年8月12日至2006年9月27日，担任普润基金基金经理；2005年2月26日至2006年11月23日，担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2007年3月19日至11月12日，担任工银瑞信精选平衡混合型基金基金经理；2007年3月19日至2009年5月17日，担任工银瑞信稳健成长股票型基金基金经理，2007年7月18日至2010年5月20日，担任工银瑞信红利股票型基金基金经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司，2010年11月26日至2012年9月5日，担任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2011年4月22日担任大成创新成长混合型证券投资基金（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7月28日	−	8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年任职于华安大华基金研究部；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日至2015年7月23日起担任大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年7月24日起任大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年4月7日起任及大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，2015年7月28日起任大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）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》、《大成创新成长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，大成创新成长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3季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在60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3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

经过几个月的调整，当前A股的整体估值水平已经显著下降，部分在产业内具备核心竞争力的优秀企业已经出现了较高的投资性价比，本基金致力于寻找该类企业并在合适价格买入。同时经济转型没有退路，对于一些估值体系尚不稳定的新兴产业，我们也基于团队能力和产业前景，适当放宽企业盈利的选择门槛。总的来说，努力寻找优质标的的同时，防范经济下行的潜在风险，努力为持有人带来回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为0.961元，本报告期基金份额净值增长率为−22.75%，同期业绩比较基准收益率为−19.72%，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

由于A股目前已经有近2800家上市公司，构建一个基金组合仅需要20只股票，所以本基金放弃基于风格、主题、行业等配置思路，完全基于自下而上的选股。

展望四季度，我们认为可能是今年7月初那个低点以来，市场第二个具备操作价值的窗口，尽管我们无法准确判断这个时点、指数的点位。本基金将继续紧密跟踪，希望能够在关键位置果断布局。

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	1,137,359,974.96	46.46
	其中：股票	1,137,359,974.96	46.46
2	基金投资	−	0.00
3	固定收益投资	−	0.00
	其中：债券	−	0.00
	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	1,307,866,493.77	53.42
8	其他资产	3,025,546.45	0.12
9	合计	2,448,252,015.18	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	795,244,251.27	32.72
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	97,031,841.48	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	50,850,723.28	2.09
H	住宿和餐饮业	−	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,871,711.15	0.98
J	金融业	69,132,766.78	2.84
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	101,228,681.00	4.17
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	1,137,359,974.96	46.80

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	300078	思创医惠	3,736,265	229,780,297.50	9.46
2	000910	大亚科技	8,721,925	140,597,431.00	5.79
3	600661	新南洋	3,665,050	101,228,681.00	4.17
4	000938	紫光股份	1,403,102	97,894,426.54	4.03
5	002462	嘉事堂	2,645,361	97,031,841.48	3.99
6	600305	恒顺醋业	4,800,351	95,286,967.35	3.92
7	601336	新华保险	1,929,466	69,132,766.78	2.84
8	002711	欧浦智网	2,111,741	50,850,723.28	2.09
9	300447	全信股份	845,139	48,620,846.67	2.00
10	002584	西陇化工	1,845,290	46,482,855.10	1.91

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。

本基金投资的前十名证券之一科伦药业，2015年4月22日，公司收到《中国证券监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书》：（一）科伦药业未按照规定披露临时报告；（二）科伦药业《2011年年度报告》和《2012年年度报告》存在重大遗漏。本基金认为，对科伦药业的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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	2,736,082.57
2	应收证券清算款	−
3	应收股利	−
4	应收利息	240,501.56
5	应收申购款	48,962.32
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	3,025,546.45

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	000938	紫光股份	97,894,426.54	4.03	重大资产重组

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	2,642,120,327.03
报告期期间基金总申购份额	81,537,688.83
减：报告期期间基金总赎回份额	194,409,087.98
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	2,529,248,927.88

§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、2015年10月15日，基金管理人发布了《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十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

2、2015年10月16日，基金管理人发布了《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十次会议审议通过，周立新先生担任公司副总经理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》；

2、《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）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10月24日

大成丰财宝货币市场基金

2015 第三季度 报告

2015年9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10月24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10月22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7月1日起至9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	170,960,502.67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，在风险与收益的权衡中，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	106,141,636.07份	64,818,866.60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7月1日 — 2015年9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	1,214,023.80	745,764.98
2. 本期利润	1,214,023.80	745,764.98
3. 期末基金资产净值	106,141,636.07	64,818,866.60

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

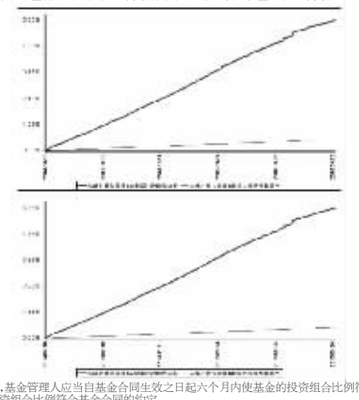
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①−③	②−④
过去三个月	0.8640%	0.0132%	0.0882%	0.0000%	0.7758%	0.0132%

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	0.9250%	0.0132%	0.0882%	0.0000%	0.8368%	0.0132%

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		
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日起大成景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日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年12月23日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。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21日起，任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。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，任大成景祥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3季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在60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3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年三季度债券市场延续良好走势，在权益市场大幅震荡、经济基本面疲软和央行宽松货币政策推动下，各债券品种表现靓丽，尤以中长端收益率下行幅度最大，债券收益率曲线牛市走平。从指数来看，中债综合财富总指数上涨2.10%，其中，中债综合财富（7−10年）指数涨3.46%，中债综合财富（1−3年）指数涨1.25%。

操作上，我们及时做好市场分析和研判，在保证流动性基础上，加大存款、短期融资券等资产配置，适当参与波段操作，合理化组合久期和流动性，提高组合获取收益能力，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0.8640%，B类净值收益率0.9250%，期间业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们认为债券市场仍然处于牛市。在三期叠加和房地产、汽车消费周期性下行影响下，经济面临较大下行压力，同时受制于结构调整、制造业去产能和债务去杠杆，政府无法简单动用强刺激政策，这种纠结矛盾甚至说比较困难的经济局面对债券市场是相当有利的。整体看，我们仍然看好债券市场表现。

四季度，我们将进一步做好组合投资管理，增加组合操作灵活性，加大债券波段操作，同时密切关注信用信用风险敞口，集中配置优质中高评级债券，利用时点因素适当增加存款配置，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	70,052,970.48	36.70
	其中：债券	70,052,970.48	36.70
	资产支持证券	−	−
2	买入返售金融资产	49,500,674.25	25.93
	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	70,448,583.49	36.91
4	其他资产	876,559.26	0.46
5	合计	190,878,787.48	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	8.67	
	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	19,499,770.75	11.41
	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	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：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	46.76	11.41
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	−	−
2	30天(含)−60天	5.85	−
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	−	−
3	60天(含)−90天	11.70	−
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	−	−
4	90天(含)−180天	11.69	−
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	−	−
5	180天(含)−397天（含）	35.14	−
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	−	−
合计		111.14	11.41

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	9,986,820.17	5.84
	其中：政策性金融债	9,986,820.17	5.84
4	企业债券	−	−
5	企业短期融资券	60,066,150.31	35.13
6	中期票据	−	−
7	同业存单	−	−
8	其他	−	−
9	合计	70,052,970.48	40.98
10	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	041560045	15阳湖龙CP001	100,000	10,040,585.34	5.87
2	041558028	15金域CP001	100,000	10,038,057.44	5.87
3	071521006	15渤海证券CP006	100,000	9,998,946.26	5.85
4	041561029	15盐城城南CP001	100,000	9,996,564.34	5.85
5	041556027	15长沙先导CP001	100,000	9,996,169.26	5.85
6	041559058	15天富CP001	100,000	9,995,827.67	5.85
7	150403	15农发03	100,000	9,986,820.17	5.84

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	6
报告期内偏离度的最高值	0.3062%
报告期内偏离度的最低值	0.0863%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1491%

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,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摊销。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	876,559.26
4	应收申购款	−
5	其他应收款	−
6	待摊费用	−
7	其他	−
8	合计	876,559.26

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	103,059,276.71	82,685,876.44
报告期期间基金总申购份额	214,253,779.41	10,750,510.76
减:报告期期间基金总赎回份额	211,171,420.05	28,617,520.60
报告期期末基金份额总额	106,141,636.07	64,818,866.60

§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、2015年10月15日，基金管理人发布了《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十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

2、2015年10月16日，基金管理人发布了《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十次会议审议通过，周立新先生担任公司副总经理职务。

§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10月24日

大成高新技术产业股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9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10月24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10月22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7月1日起至9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	176,307,358.33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