# 大成互联网思维混合型证券投资基金

#### **2015 第四季度** 报告

组合报告等内容,保证复核内容不存在 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽	根据本基金合同规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和 近常配记载,误导性陈述或者重大遗漏。 "我的原则管理取出基金资产。但不保证基金一定盈利。 现。投资者风险,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。 [31日止。 52基金产品概况
基金简称	大成互联网思维混合
交易代码	001144
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	2,153,015,486.10%
投资目标	嫌挺互联网技术与思维向实体经济与金融各领域渗透的过程中各个行业出现的 投资机会,为投资者提供分享互联网技术与思维带动经济发展与企业盈利增长, 红利,为争通过限联生动处管理来项基金资产长期超定增值。
投資策略	本基金通过对证明经济环境。国家经济查询。原南市场风险。债券市场整体收益 曲线变化和资金供求关系等因素的分析。而到经济周期在卖转投资时等现役所 前的股、综合评价各类数产的市场趋势。指则风险效益关于和配置时间,在在途 他上,本基金将积极、主动绘画论反复类资产。因业收益类资产和现金等各类资 的使用比例对此行业时态温度。
业绩比较基准	沪深300指数收益率x60%+中证综合债券指数收益率x40%
风险收益特征	中高风险
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

§ 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

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:2016年1月20日

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	87,342,718.60
2.本期利润	320,362,028.84
3.加权平均基金份額本期利润	0.1433
4.期末基金资产净值	1,841,334,625.05
5.期末基金份额净值	0.855
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收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	

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	业绩比较基准收益率 标准差④	1)-3)	2-4
过去三个月	19.25%	2.22%	10.87%	1.00%	8.38%	1.229
3.2.2 自基金台	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	
26.00%	۸ ۸					
20.00.0	n/\/\					
	. /					
12.00%	M					
	1 2/	7				
	IN					
	W	٦.				
1004	W	٦				
0 00% A		V.M.	m			_
100%		War The	M	_/		
		Jan Jan	m	m	mm	
1005 A		1/2	m	~~	mm	~
			M	~~	mm	~
13.00% -			M	- M	my	~~
13.00% -			M	m	my	<u></u>
	M		M/~	- m	My	~~
13.00% -	W		Mr.	- m	my	ĵ.
13.00% -	<i></i>		M.	and .	mm	~~
13.00% -			whi		mtn	~~
13.00% -	LV nices			and a	my	~~ manner

10	一人在大家河岸市市	混合的联系计符生物二年	大成大森林森伊斯兰	** 电电话电话 电电话	
		4月21日,截至报告期末			
	合同规定,本基金自基金	:合同生效之日起6个月2	内为建仓期。建仓期:	结束时,本基金的投资约	且合比例符合基金
合同的约定。					

14.44	职务	任本基金的基	金经理期限	ar de 11 de de ma	说明
姓名	BT 99	任职日期	离任日期	证券从业年限	0691
李博先生	本基金基金经理	2015年4月21日	-	<b>4</b> 年	工学业上 2000年9月第2010年 月级银产特配5K Teleom 678 5K 第2010年8月至201年5月就 月工程的证券任理公司。1914年3月 100年5月 100年5月 100年5月 100年5日

则。成交沙的等交易结果数据表明该套交易不对市场产生重大影响,无异常,投资组合同虽然存在同向交易行为,但结合易价差分市线计分析保险社和检验金额统计结果表明投资组合同不存在和结输运的可能性。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
811亿元度,市场比明了一次金波,上址等排下推至2850点,创业板指数下推至1780点,随后市场在底部盘整了一段时间开始企稳。复合我们对后市的判断。12月7日美联结加息如期落地,但市场对于2016年美联储加息的步伐还是有所分导致12月市场主势格显硬铁。基于如上的判断,我们加大了合位的配置。在行业和个股选择上,主要考虑超跌反弹个股,市场进入四季度后主题投资台盛行,我们如期把握住了VR、IP运营和断能源汽车等主题投资组会。
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0.855元,本报告期基金份额净值增长率为19.25%。同期业绩比较基相收益率为75%。高于通机交基础的表达基础的表现。

4.5 管理人对宏观经济证券市场及行业走势的高度限望 2016年第一个交易1一式火发房开始实施膨胀制制,根据感吸效应,在涨跌停板和熔断机制下,市场战动性往往加大。 现11到斯2016年将会是一个燃暖营养的行情,主要原因是,(1)货币政策整处效应过度;上在减弱。2015年是近年来最为边际 宽松的一年,2016年货币政策边际宽松的效应正在减弱,我们预计今年还会有两次停息和4次停准。(2)银行理财及保险资 金人市是2016年最大的利料信息。(3)人民币汇率被动及贬值预期是2016年资本市场最大的利定。综合来看,我们认为今 年将是一个宽优震荡的行情。 基下这个影响;我们将银转中性仓位、精造个股为主,主要的行业选择集中在优质成长股之中。 4.5 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

§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

个别及走帝群任。 基金往常人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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企整记载、误守结然达成者重大造量。 基金管四人来部边域实信用,勤勉是界的原则管理和证用基金资产。但不保证基金一定盈利。 基金管由生业维持不代表其未来表现。投资有风险,投资套在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募设明书。 本程也中财务资料未经当时, 本报生中财务资料未经当时, 本报生的是1015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

51 1	设告期末基金资产组合 	3会情况						
N-1 10		EH .		金額(元)		4:1	金总资产的比例(%)	
1	权益投资				1,626,884,043.39		87.39	
	其中:股票				1,626,884,043.39		87.39	
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	买人返售金融资产				-		0.00	
	其中:买断式回购的买	民人返售金融资产			-		0.00	
7	银行存款和结算备付	金合计			232,526,055.42		12.49	
8	其他资产				2,245,004.22		0.12	
9	合计				1,861,655,103.03		100.00	
5.2 指	2告期末按行业分类	色的股票投资组合						
代码		行业类别		公允份	〉值(元)	r!	5基金资产净值比例(%)	
A	农、林、牧、渔业					-	0.0	
В	采矿业	<b>杂矿业</b>				-	0.00	
C	制造业				707,062,037.	72	38.40	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业					-	0.00	
E	建筑业				37,291,708.	12	2.03	
F	批发和零售业	批发和零售业			1,023,435.0	00	0.00	
G	交通运输、仓储和邮票	KANK.				-	0.00	
Н	住宿和餐饮业				42,006,111.	95	2.28	
I	信息传输、软件和信息	!技术服务业			481,714,387.	21	26.16	
J	金融业					-	0.00	
K	房地产业				75,689,006.	79	4.11	
L	租赁和商务服务业				42,934,356.00		2.33	
M	科学研究和技术服务			=		0.00		
N	水利、环境和公共设施					-	0.00	
0	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				95,032,333.	_	5.16	
R	文化、体育和娱乐业				144,130,666.	30	7.83	
S	综合					-	0.00	
15	合计	L Lake A Washingt Chill Son			1,626,884,043.	39	88.35	
		<b></b> 占基金资产净值比例					base A Market Mart Mart	
字号.	股票代码	股票名称	3	效量(股)	公允价值()		占基金资产净值比例(%)	
1	002355	兴民钢圈		6,749,253		390,015.18	7.35	
2	002517	泰亚股份		2,191,715	- ,	586,426.10	7.21	
3	002044	江苏三友		3,359,220		032,333.80	5.16	
5	300104	乐视网		1,425,182		767,452.76	4.66	
	002174	游族网络	1	908,700	76,	585,193.00	4.16	

9 002113 天同陸股 1.253,035 49,745,489.50 2.70
10 000687 年11万年 1.718.743 46,440,435.86 2.52
25 1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基企本报告期末未持有债券。
本基企本报告期末未持有债券。
5 报告期末校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
本基企本报告期末未持有债券。
在基金报告期末未持有债务。
5 报告期末校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
本基企本报告期末未持有债务。
5 报告期末校公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债金属投资明细
本基企本报告期末未持有债金属。
5 报告期末处公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债金属投资明细
本基企本报告期末未持有债金属。
5 报告期末本基金投资的股指期债金和股益明细
本基企本报告期末未持有核定。
5 报告期末本基金投资的股指期债金和股益明组
本基金本报告期未决持有核股份。
5 报告期末本基金投资的股指期债金和股益明组
本基金企报台期未被免费的股指期债金和股益明组
本基金企报台期未被免疫情的股份的资金,在股险可称的前五名权企和股益明报的投资中转卸货。
5 10 报告期末本基金投资的股指期货余仓和股益明组
本基金企报台期未收货应申请取保险管理的原则。以参期保值为目的,在风险可称的前据下,参与股指期货的投资、此本基金定报的服货投资中销租风险管理的原则,以参期保值为目的,在风险可称的前据下,参与股指期货的投资。此本基金定报告期末投资证的原则股务情况说明
本基金本报告期末发资证的原则股务情况说明
5 10 11 本期国债则投资证价。
本基金本报告期末收货证面值期货。
5 11 11 其是证明值期投资证明的,

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

	平基金投資的則下名 其他资产构成	以宗中,汉有按贺丁	超出基亚合同规正备选	又采库之外权宗。	
序号	名利	Ę.		金額(元)	
1	存出保证金				2,141,728.24
2	应收证券清算款				-
3	应收股利				-
4	应收利息				31,437.57
5	应收申购款				71,838.41
6	其他应收款				-
7	待摊费用				-
8	其他				-
9	合计				2,245,004.22
本基金	报告期末持有的处于转 2本报告期末未持有处 报告期末前十名股票。	于转股期的可转换值	<b>责券</b> 。		
成品	85 W 44 ZII	影響女教	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	<b>安泽</b> 罗斯德汉语图

9	台げ				2,245,004.22
本基金	报告期末持有的处于 企本报告期末未持有处 报告期末前十名股票	于转股期的可转换(	责券。		
序号	B 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	002044	江苏三友	95,032,333.80	5.16	重大事项
2	300104	乐视网	85,767,452.76	4.66	重大事项
3	002174	游族网络	76,685,193.00	4.16	重大事项
E 11 6	<b>机次和人セ生料注析</b>	日本中今世界如八			

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。	开放式基金份额变动
30 /	单位:
报告期期初基金份额总额	2,332,724,438.66
报告期期间基金总申购份额	81,690,452.23
减:报告期期间基金总赎回份额	261,399,404.79
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	2,153,015,486.10
§ 7 基金管理人 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。	运用固有资金投资本基金情况

9.1 备查文件目录 1.中国III 富会批准设立大成互联网思维混合型证券投资基金的文件; 2.长元近互联网思维混合型证券投资基金会合同)。 3.长元近互联网思维混合型证券投资基金并管协议); 4.大成基金管理有限公司批准文件、置处组服、公司章程; 5.本报告期内在指定报刊上披露的各种公告顺稿。 9.2 充协由5.2

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。

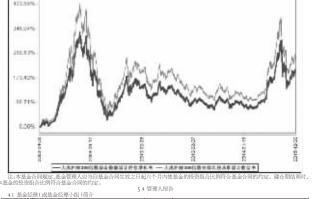
9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

### 大成沪深300指数证券投资基金

#### 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

报告送出日期; 20 基金管理人的董 2个别及连带责任。 基金托管人中国 5等内容。保证复核内 基金管理人等话。 基金管理人等的过往业绩 基金的过往业绩 本报告中财务资	事会及董事保证本根的 农业银行股份有限公司 容不存在虚假记载、 以诚实信用、勤勉尽责 并不代表其未来表现。	告所载资料不存在 可根据本基金合同 具导性陈述或者重 的原则管理和运用 投资有风险,投资	§1 重要提示 虚假记载、误导性陈述或 规定。于2016年1月18日复 大遗漏。 用基金资产,但不保证基金 资者在作出投资决策前应付 §2 基金产品额况	核了本报告中的财务指 :一定盈利。	标、净值表现		
基金简称			大成沪深300指数				
交易代码			519300				
前端交易代码							
后端交易代码			519301				
基金运作方式			契约型开放式				
基金合同生效日			2006年4月6日				
报告期末基金份额总	. Mi		1,928,620,557.6819				
投资目标			通过严格的投资程序约束和 差的最小化。在正常市场时 0.35%,年限踪误差不超过4	青况下,本基金日均跟踪值			
投资策略			本基金采用被动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来报合 复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。				
业绩比较基准			沪深300指数				
风险收益特征			本基金为指数基金,是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。				
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				
3.1 主要财务指标	R	§ 3 主要	财务指标和基金净值表现			单位:人民币元	
主要财务指标			报告期(	2015年10月1日 - 2015年	12月31日)		
1.本期已实现收益						23,494,813.30	
2.本期利润	I. Here was a trans				3	41,381,227.14	
3.加权平均基金份额	<b>本期利润</b>		0.1734				
4.期末基金资产净值			2,299,897,522.96				
5.期末基金份額净值		ılk- 1 − 4π ≥4e ilk-ΔΔ − 4	其他收入(不含公允价值多	TO ME ALTER A PORT / ALABATES	EM-45	1.1925	
2、所述基金业绩 3.2 基金净值表现	公允价值变动收益。 指标不包括持有人交易	易基金的各项费用	,计人费用后实际收益水		//LIH5/8/(1945)	971-381-37-37-4-593	
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	业绩比较基准收益率 标准差④	1)-(3)	2-4	
过去三个月	16.65%		4% 16.49%	1.67%	0.16%	-0.03%	
3.2.2 目基金合同	生效以来基金累计净	值增长率变动及非	(与同期业绩比较基准收)	<b>监率变动的比较</b>			
422,55%- 348,04%-	W				4	1	



姓名	田务 任本基金的基金经理期限 证券从业	说明			
XI.43	865397	任职日期	离任日期	年限	170,911
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年8月26日	-	5年	台计等单元。2016年7月加大垃圾基金管理有限处司,历任研究 邮件资金、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、股份、
注:1、任职	□ 8H 18Y/I □ 8H	为太其会管理人作	出决定之日。		基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

序号	項目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,107,191,819.17	91
	其中:股票	2,107,191,819.17	91
2	基金投资	-	0
3	固定收益投资	50,060,000.00	2
	其中:债券	50,060,000.00	2
	资产支持证券	-	0
4	贵金属投资	-	0
5	金融衍生品投资	-	0
6	买人返售金融资产	-	0
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	0
7	银行存款和结算备付金合计	144,321,760.67	6.
8	其他资产	3,033,051.34	0
9	合计	2,304,606,631.18	100

	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	2,173,938.48	0.09
В	采矿业	75,674,189.65	3.29
C	制造业	679,561,029.04	29.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,682,070.89	3.99
E	建筑业	80,035,344.09	3.48
F	批发和零售业	53,796,648.73	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	89,200,688.17	3.88
Н	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,491,561.34	5.76
J	金融业	689,797,088.09	29.99
K	房地产业	106,237,716.10	4.62
L	租赁和商务服务业	27,072,662.42	1.18
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	23,180,858.87	1.01
0	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	3,751,325.04	0.16
R	文化、体育和娱乐业	40,154,103.16	1.75
S	综合	12,382,595.10	0.54
	合计	2,107,191,819.17	91.62
5.3 报位	告期末按公允价值占基金资产净值比例大小	卜排序的前十名股票投资明细	

5	600000	浦发银行	1,960,53	35	,818,901.37	1.56
6	000002	万 科A	1,386,11	35 33	,864,499.55	1.47
7	600030	中信证券	1,585,0	9 30	,669,924.15	1.33
8	601169	北京银行	2,862,9	14 30	,146,484.42	1.31
9	601939	建设银行	4,757,74	10 27	,499,737.20	1.20
10	601328	交通银行	4,067,1	11 26	,192,194.84	1.14
5.4 报行	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)	- i	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			50,060,000.00		2.18
	其中:政策性金融债			50,060,000.00		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(可交换债)			=		0.00
8	同业存单			-		0.00
9	其他			-		0.00
10	合计			50,060,000.00		2.18
5.5 报行	告期末按公允价值占	基金资产净值比例为	小排序的前五名债券投资	<b>管明细</b>		
NV.EL	28 No. 45 TT	DE SE SE EN	90: SE / SV \	0. A (A (A) (A) (		Hart A Strate Wester Land Court

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十名资产支持证券投资 本基金末指告期末按与省产产业产业等投资。 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贵金属投资押细 本基金末指告期末转有有金属性按。 5.8 报告期末按有有金属性按。 本基金末指告期末未持有优重投资。

	<b>应收证券資料款</b>				
3	应收股利				-
4	应收利息				1,670,875.40
5	应收申购款				275,047.35
6	其他应收款				-
7	待摊费用				-
8	其他				-
9	合计				3,033,051.34
本基金2	设告期末持有的处于转版 本报告期末未持有处于转 设告期末前十名股票中右	股期的可转换债券。			
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	000002	万 科A	33,864,499.55	1.47	重大事項

§ 6	开放式基金份额变动
	单位:
报告期期初基金份额总额	2,009,513,295.78
报告期期间基金总申购份额	53,209,308.24
减:报告期期间基金总赎回份额	134,102,046.34
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	1,928,620,557.68
c a 4t ∧ fotoma	ニロロナルトボルナサトはロ

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。 2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

大成基金管理有限公司 2016年1月20日

# 大成货币市场证券投资基金

## **2015 第四季度** 报告

2015年12月31日

HITTS.					/
22:62%					
14.73%			/		
16,29%			/		
0.19%		_			
#18%			-		
987.98	15	72 8 8	81.0	-	D 8.2
-		Hieness X	ensummer.	***	
本基金的投资组合比例 2、为使本基金业绩与 V绩比较基准由"税后-	2.基金管理人应当自基金 利符合基金合同的约定。 其业绩比较基准具有更强 一年期银行定期存款利率 2008年5月31日为原业绩比	的可比性,经大成基金管 "	管理有限公司申请,并经 :利率"。 本基金业绩H	中国证监会同意,自2008 ·较基准收益率的历史走	3年6月1日起, :势图从2005年

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 净值收益率① 净值收益率标准差② 1)-3)

单位:人民币:

净值收益率① 净值收益率标准差②

3.1 主要财务指标

W NW				/
26.32%			_/	
21.90%		/		
14.30%		/		
1.27%				

— 人名贝辛·斯曼莫尔沙的歌森林。——人名贝尔·斯特比较高原其计数品参

1212%				/	
14.23%			/		
16.09%			/		
0.17%					
-22.00					
W10%					
	11 .12 .48	220.002	28-1-10-10-10-10-10-10-10-10-10-10-10-10-1	# F F F F F F F F F F F F F F F F F F F	
0.20%		71 75 80 80 80 80 80 80 80 80 80 80 80 80 80	N 2 	# F R	

姓名 职务

99「脏性。 4.4 报告期内基金投资资源和业绩表现设明 4.41 报告期内基金投资资源和运序分析 2015年享享率度支险另行政资源的数据本面推动下、债券市场牛市依旧、各期限各品种收益率都不断下行、尤以中长端收益率下行幅度 5、从指数来看,四季度中债综合财富总指数上涨2.73%。货币市场在面对11月份新股重启冲击后资金面仍然宽松、短脑、存款收益率不断

下帶。 操作上、本组合根据市场大幅波动走势和各种政策变化。灵活调整组合仓位结构,在四季度货币市场收益率短期上行之际。大幅增加短期 融资券和序游配置。同时根患与波段操作。为组合获取了一定收益。 4.4.2 报告则法是创业债券

2016年 参与债券 我们非 問整组合 4.6 报(	。在这个过程中,经济预计会出现比较痛苦的 大幅胶值的趋势性因素是不存在的。阶段性 序度、我们标点关注个综信用风险,提高 波段操作,增强组合收益。 常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们 结构。研究部的设备上标和挖掘投资机会, 当构,构造	人库标准,降低组合信用风险敞口,进一 将按照本基金合同和风险收益特征的要 力争获得与基金风险特征一致的稳定收益	中央政府准备下大力气抓去产能、去库存。 建货币政策和财政政策的河护和对冲。另外 。整体我们仍然看好债券市场。 步加强流动性管理,增加组合操作灵活性, 求、严格控制投资风险,积极进行资产配置 求、严格控制投资风险,积极进行资产配置
无。	<b>-</b>	§ 5 投资组合报告	
5.1 fg	当期未熟並與广组合情のC 原目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,947,489,311,36	15.85
	其中:债券	9,947,489,311.36	15.85
	资产支持证券	_	0.00
2	买人返售金融资产	22,116,632,637.90	35.24
	其中,买断式回购的买人返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	28,501,851,605.85	45.42
4	其他资产	2,189,222,436.20	3.49
5	合计	62,755,195,991.31	100.00
	占期债券回购融资情况		
序号	項目	占基金资产	"净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		0.25
	其中:买斯式回购融资		_
序号	項目	金額	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额 其中:买断式回购融资	_	0.00
5.3 基金	期内无债券正回购的资金余额超过基金资产 金投资组合平均剩余期限		
3.3.1 1	と资组合平均剩余期限基本情况 Title		工物
	項目		天数
报告期末	项目 F投资组合平均剩余期限		42
报告期末报告期内	项目 投资组合平均剩余期限 投资组合平均剩余期限最高值		42 114
报告期末报告期内报告期内报告期本报告	项目 F投资组合平均剩余期限		42
报告期末报告期内报告期内报告期本报告	项目  投资组合平均剩余期限 起资组合平均剩余期限最高值 投资组合平均剩余期限最高值 投资组合平均剩余期限最低值 内投资组合平均剩余期限超过180天情况说 期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况说		42 114
报告期末 报告期内 报告期内 报告期本报告 5.3.2 指	項目 投資租合平均剩余期限最高值 投资租合平均剩余期限最高值 投资租合平均剩余期限最低值 內投资租合平均剩余期限超过180天情况说 期均不足使组合平均剩余原限超过180天情	情况。	42 114 42 各期限负债占基金资产净值的比例(%)
报告期末报告期内报告期内 报告期内 报告期内本报告期本报告 5.3.2 指 序号	項目 投資租金平均剩金剛展 投資租金平均剩金剛用最高值 投資租金平均剩金剛用最新值 投資租金平均剩金剛和報信 同時支柱於對金等均剩金剛設超过180天前 在初期大使的社会平均剩金剛設超过180天前 在初期大使的社会平均剩金剛設	情况。 各期限资产占基金资产净值的比例(%)	42 114 42
报告期末报告期内报告期内 报告期内 报告期内本报告期本报告 5.3.2 指 序号	項目 投資組合平均剩金期限 投資組合平均剩金期限最低值 投資組合平均剩金期限最低值 內投資社合平均剩金期限最限过180天情况促 使 有限資本投資組合平均剩金期限期限超过180天的 在期末投資組合平均剩金期限分布比例 平均剩金期限 30天以內	情况。  各期限资产占基金资产净值的比例(%)  68.8	42 114 42 各期限负债占基金资产净值的比例(%) 4 0.00
报告期末报告期内报告期内报告期内本报告期内本报告期内本报告书	項目 投資组合平均剩金期限 建设组合平均剩金期限基底值 建设组合平均剩金期限最低值 内设在经合平均剩金期限最低值 内设在经合平均剩金期限最低组 为设在经合平均剩金期级分前比例 平均剩金期级分前比例 其中,剩金存然期超过307天的浮动利率值 其中,剩金存然期超过307天的浮动利率值	情况。 各期限资产占基金资产净值的比例(%) 68.8 0.0 1.7 0.0	42 114 42 多期股合领占基金资产净值的比例(%) 4 0.00 0 0.00 7 0.000
报告期末报告期内报告期内本报告期本本报告期本报告	項目 投資组合平均剩余期限 投資组合平均剩余期限基本值 12位组化产均剩金期限基本值 12位组化产均剩金期限超五值 用投资组合平均剩余期限超过100大销价设施 期内无税劳组合平均剩余期限投过100大的 在制度上投资组合平均剩余期限分布比例 平均剩余期限分布比例 其中,剩余存款则超过207天的浮动利率值 30天位为-60天 其中,剩余存款期超过397天的浮动利率值 60次位为-90天	情况。 各期限资产占基金资产净值的比例(%) 68.8 0.0 1.77 0.0	42 114 42 各期限负债占基金资产净值的比例(%) 4 0.00 0 0.000 7 0.000 0 0.000
报告期末报告期内报告期内报告期内报告期内报告期份的报告期份的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的	项目 投资组合平均剩余前限 投资组合平均剩余前限基本值 投资组合平均剩余间限基本值 投资组合平均剩余则限超过 100 下值 用设存组合平均剩余则限超过 100 下值 是有一个均剩余则限超过 100 下值 是有一个均剩余则则是过 100 下值 是有一个均剩余则则是过 100 下值 是有一个均剩余则则是一个时间 其中,剩余在结则超过397元的浮动刺率值 其中,剩余在结则超过397元的浮动刺率值 其中,剩余在结则超过397元的浮动刺率值	情况。	42 114 42 各期联负债占基金资产净值的比例(%) 4 0,000 7 0,000 0 0,000 0 0,000
报告期末报告期内报告期内报告期内本报告期内本报告期内本报告书	項目  投資组合平均剩金期限  投資组合平均剩金期限最高值  投资组合平均剩金期限最低值  用投入投资化合平均剩金期限最低值  用投入投资化合平均剩金期限是可以180大的合产的未投资组合平均剩金期股产的比例	情况。	42 114 42 本期限合領占基金資产浄値的比例(%) 4 0.00 0 0 0.00 0 0 0.00 0 0.00 0 0.00 0 0 0.00 0 0 0.00 0 0 0.00 0 0 0.00 0 0 0.00 0 0 0.0
报告期末报告期标报告期标本报告期本本报告期本本报告期本本报告的目标。	項目 投資组合平均剩余加限 投資组合平均剩金加限最高值 12位组化字均剩金加限最高值 12位组化字均剩金加限超低值 用处度程化字均剩金加度的原则超过100大箭在设 期内支税价料合字均剩金加度的原建过100大箭在设 期内支税价料合字均剩金加度分前比例 平均剩金加度 其中,剩金存燃期超过397大的浮动利率值 30天位5-60天 其中,剩金存燃期超过397天的浮动利率值 60万位5075万万浮动利率值 60万位5075万万浮动利率值	情况。	42 114 42 各期股负债占基金数产净值的比例(等) 4 0 0,00 0 0 0 0,00 0 0 0 0,00 0 0 0 0
报告期末报告期内报告期内报告期内报告期内报告期份的报告期份的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的报告的	項目 投資组合平均剩余前限 投資组合平均剩余前限 投資组合平均剩余前限 投資组合平均剩余前限 建设在中均剩余前限超过 内限方组合等均平均剩余前限超过1897代前花成 内限方组合等均平均剩余期限超过1897代前花成 一种剩余的限量。 一种剩余的限量。 其中,剩余在整期超过397天的浮动利率值 多位。 其中,剩余在整期超过397天的浮动利率值 90天(金)—180天 其中,剩余在整期超过397天的浮动利率值 90天(金)—180天 其中,剩余在整期超过397天的浮动利率值 180天(金)—397天(金)	情况。	42 114 42 43 4 4 0.00 6 0.00 7 0.00 0 0 0 0
报告期末报告期标报告期标本报告期本本报告期本本报告期本本报告的目标。	項目 投资组合平均剩余期限最高值 投资组合平均剩余期限最高值 投资组合平均剩余期限最高值 投资组合平均剩余期限最高值 用收费组合平均剩余期限超过180大简在(迈 期内无投货组合平均剩余期限超过180大商在(迈 期内无投货组合平均剩余期限 对金标期间,200天组为中间 其中,剩余存储期超过397天的浮动利率值 400天(6)—80天 其中,剩余存储期超过397天的浮动利率值 90天(6)—180天 其中,剩余存储期超过397天的浮动利率值 180天(6)—180天 其中,剩余存储期超过397天的浮动利率值 180天(6)—397天(6) 其中,剩余存储期超过397天的浮动利率值	情况。     各期限资产占基金资产净值的比例(%)	42 114 42
报告期末报告期的报告期前 报告期的 报告期前 报告期前 报告期前 不报告报告报告报告报告报告报告报 1 2 3 4 4 5	項目 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余期限 建設 (	情况。	42 114 42
报告期末报告期的报告期待 报告期的报告的报告的报告的 1 2 3 4 5 5 4 报行	項目 投資组合平均剩余期限 投資组合平均剩余期限 直接資租合平均剩余期限 通信 控發租合平均剩余期限 通信 内限 方程 分明 表現	情况。	42 114 42 本期限合領占基金資产净值的社(%) 4 0.00 7 0.00 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0 0 0.00 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
报告期末报告期的报告期前 报告期的 报告期前 报告期前 报告期前 不报告报告报告报告报告报告报告报 1 2 3 4 4 5	項目 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余劑限 投資組合平均剩余期限 建設 (	情况。     各期限资产占基金资产净值的比例(%)	42 114 42
报告期末报告期内报告期内报告期内报告期本5.3.2 有 1 2 3 4 5 5.4 报保	项目 投资组合平均剩余前限 投资组合平均剩余前限 投资组合平均剩余前限 投资组合平均剩余前限超级值 内投资组合平均剩余前限超级值 用处理结合平均剩余则限超过100天的 产的现在分割的,分布比例 平均减分期限分布比例 平均减分期限分布比例 其中,剩余存载期超过397天份浮动刺单值 30天(2)-90天 其中,剩余存载期超过397天的浮动刺单值 90天(2)-180天 其中,剩余存载期超过397天的浮动刺单值 180天(2)-397天(6)	情况。	42 114 42 4 4 4 0,00 7 0,00 0 0 0 0,00 0 0 0 0,00 0 0 0 0,00 0 0 0 0
报告期末 报告期末 报告期内 报告期内 日 1 2 3 4 5 5 4 5 1	項目 投資组合平均剩余期限 投資组合平均剩余期限 基本值 建立,在 中均剩余如明和 是	情况。	42 114 42

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	推余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150206	15国开06	3,000,000	300,529,107.26	0.48
2	150202	15国开02	2,800,000	280,115,613.94	0.45
3	150222	15国开22	2,400,000	239,350,678.68	0.38
4	011517004	15年电SCP004	2,000,000	200,677,032.52	0.32
5	011510007	15中电投SCP007	2,000,000	200,147,402.41	0.32
6	150215	15国开15	2,000,000	200,049,732.03	0.32
7	150413	15次发13	2,000,000	199,908,748.60	0.32
8	011508003	15年能集SCP003	2,000,000	199,816,303.96	0.32
9	011599543	15陕延油SCP002	1,700,000	169,915,721.96	0.27
10	011560003	15东航SCP003	1,700,000	169,846,353.98	0.27
5.6 "影	'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
报告期日	5.信室座的绝对值2	年0.25(念)_0.5%间的	(12/or #Vr		_

5.6 "影刊	子定价"与"摊余成本法"码	角定的基金资产净值的	的偏离		
	19	iΒ		偏离	情况
报告期內	内偏离度的绝对值在	0.25(含)-0.5%间	的次数		-
报告期内	为偏离度的最高值				0.1474%
报告期内偏离度的最低值				0.0492%	
报告期内	内每个工作日偏离度	的绝对值的简单	平均值		0.1056%
本报告期 5.8 投资约	期末按公允价值占基金资产 l末未持有资产支持证券。 组合报告附注 概金的债券投资及资产支持				利率或商定利率每日计提应

本基金每日计提收益,通过每日分红使得基金份额净值维持在1,0000元。 5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于307天但剩余存续期超过307天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 3.58.3 本基会投资的前十名证券的发行主体末出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责,处罚的情形

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	167,822,878.45
4	应收申购款	2,021,399,557.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,189,222,436.20
	资组合报告附注的其他文字描述部分 3.五人原因,分项之和与合计可能有尾差。	

§ 6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	391,869,476.06	18,789,557,386.54
报告期期间基金总申购份额	4,362,273,257.94	66,200,461,188.67
减:报告期期间基金总赎回份额	1,477,464,683.64	25,526,775,072.68
报告期期末基金份额总额	3,276,678,050.36	59,463,243,502.53
§ 7 基金管理人运用E	司有资金投资本基金情况	
本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。		
§ 8 影响投资者决	<b></b> 快策的其他重要信息	
1 社会管理 / 工2015年10日15日坐在了 / 十六社会管理专門公司	<b>平工官研究理 ( 日本市66八生 ) </b>	4-15年公然即去問八司等A-1925日

1. 基金管理人于2015年 0月15日发布了《大成基金管理有限》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. 基金管理人分别于2015年10月16日、10月30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关闭董事会十次会议审议通过,周少斯先生、温力被失生担任公司副总经理职务。 3. 基金管理人 五公司十二位的能够长管理和任政司法自发生的人员会对基金公司第二位

3、 黨並目注入于公司=人成別制贝平目注目取公司行刊平認並仍很支列目の	单位:
报告期期初持有的本基金份额	8,444,684.61
报告期期间买入/申购总份额	=
报告期期间卖出/赎回总份额	-8,464,316.36
报告期期末持有的本基金份額	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	=
注:期间收益再投资份额为19,631.75份。	

6、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办公住所。 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