大成高新技术产业股票型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月20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10月1日起至12月31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	146,885,537.83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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	18,528,809.02
2.本期利润	51,473,787.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.3132
4.期末基金资产净值	176,432,728.49
5.期末基金份额净值	1.201

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。

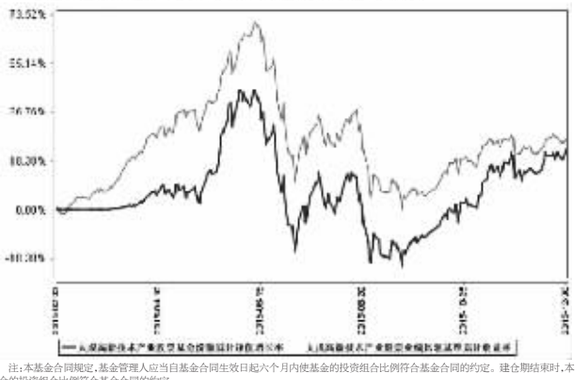
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	33.44%	2.24%	18.37%	1.61%	15.07%	0.63%

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		
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,曾任申源制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日曾任联发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日至2015年7月21日任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理。2015年7月22日起任大成策略回报混合型证券投资基金基金经理。2014年4月25日至2015年7月21日任大成竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2015年7月22日起任大成竞争优势混合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。2015年9月15日起任景阳领先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
刘旭先生	本基金基金经理	2015年7月29日	-	4年	管理学硕士。2009年至2010年在华马威华振会计师事务所任审计师;2011年2月至2013年5月任广发证券研究所研究员;2013年5月加入大成基金管理有限公司。2015年3月30日至2015年7月21日担任大成策略回报股票型证券投资基金基金经理助理。2015年7月22日至2015年7月28日担任大成竞争优势混合型证券投资基金的基金经理助理。2015年3月30日至2015年7月28日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理助理。2015年7月29日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。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同同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015年4季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在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4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

A股在四季度仍以新兴产业类和具备转型预期的股票带动上行,但部分标的已经出现阶段性显著高估和资金推动的迹象。

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1.201元,本报告期基金份额净值增长率为33.44%,同期业绩比较基准收益率为18.37%,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

变化的外部环境和内部供给侧改革的需要,都加大了边际宽松的难度。同时股市作为打通储蓄向投资转化的重要融资工具地位不会发生改变,宽频谱的资本市场是发展方向。基于以上两点我们认为2016年选股的难度较2015年提升,本基金将致力于寻找符合我国切合实际的产业升级标的,在合适的价格买入。我们难以对风险偏好作出判断,我们希望持有的公司能够具备可以研究的持续经营能力,并且是相对稀缺的品种。力争为持有人创造回报。

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	153,423,521.02	85.84
	其中:股票	153,423,521.02	85.84
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	17,086,304.39	9.56
7	其他资产	8,222,116.92	4.60
8	合计	178,731,942.33	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	115,128,460.92	65.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	181,328.00	0.10
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	18,376,588.70	10.42
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	1,841,515.51	1.04
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	11,367,340.70	6.44
L	租赁和商务服务业	6,446,086.50	3.65
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	82,200.69	0.05
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	153,423,521.02	86.96

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	002355	兴民钢圈	767,094	15,387,905.64	8.72
2	300078	思创医惠	263,623	12,864,802.40	7.29
3	300395	菲利华	235,850	11,533,065.00	6.54
4	002113	天润控股	286,331	11,367,340.70	6.44
5	002138	顺络电子	747,007	10,719,550.45	6.08
6	002126	银轮股份	573,542	10,581,849.90	6.00
7	600122	宏图高科	521,300	10,123,646.00	5.74
8	002588	史丹利	289,933	9,431,520.49	5.35
9	600647	同达创业	254,678	8,187,897.70	4.64
10	002127	新民科技	396,420	7,420,982.40	4.21

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 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	303,815.47
2	应收证券清算款	7,893,019.44
3	应收股利	-
4	应收利息	4,289.89
5	应收申购款	20,992.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,222,116.92

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	600122	宏图高科	10,123,646.00	5.74	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	176,307,358.33
报告期期间基金总申购份额	13,324,271.26
减:报告期期间基金总赎回份额	42,746,091.76
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	146,885,537.83

§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10月15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第六届董事会十次会议审议通过,周立新先生、温志敏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
2016年1月20日

大成行业轮动混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成行业轮动混合
交易代码	090009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月8日
报告期末基金份额总额	124,286,132.92份
投资目标	利用行业轮动效应,优化行业配置,获取超额投资收益,实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律,研究我国国民经济发展过程中的结构化特征,捕捉行业轮动效应下的投资机会,自上而下的实施大类资产间的战略配置和股票类例间的战术配置,精选优质行业的优质股票,获取超额投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的股票基金,预期风险收益水平高于混合基金、债券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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	33,339,167.08
2.本期利润	43,061,572.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.3414
4.期末基金资产净值	178,553,719.73
5.期末基金份额净值	1.437

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。

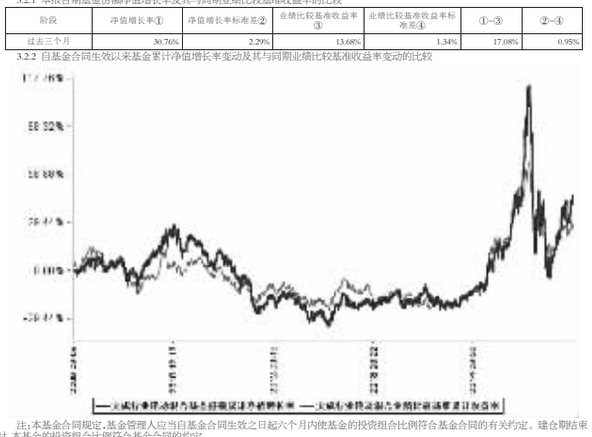
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	30.76%	2.29%	13.68%	1.34%	17.08%	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有关约定。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		
支兆华先生	本基金基金经理	2015年5月23日	2015年12月13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日至2015年12月8日任大成监等稳健证券投资基金基金经理。2015年5月23日至2015年7月2日任大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2015年7月3日至2015年12月13日任大成行业轮动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
王磊先生	本基金基金经理	2015年12月14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、挑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日至2015年7月15日起担任大成收益债券型证券投资基金基金经理。2015年7月16日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。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。2015年12月14日起任大成行业轮动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》、《大成行业轮动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,大成行业轮动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同同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015年4季度公司旗下主动投资组合同股票交易存在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4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年第四季度,股票市场在经历了前期的下跌之后趋于稳定,呈现震荡上升的态势。其原因在于国家采取了种种救市措施以稳定市场,使市场重新进入正常的运行轨道。在宏观方面,虽然经济仍然处于下行的态势,但国家采取调整结构,鼓励创新,继续保持货币政策的适当宽松,并放松房地产政策的方式对经济进行刺激,以防止经济出现继续的大幅下跌。同时,国家也提出进行供给侧改革,淘汰落后产能,鼓励兼并重组。这些都成为推动市场上涨的积极因素。同时,部分上市公司重新活跃的兼并重组又也是驱动市场上涨的重要力量。

上证指数本季度上涨15.93%,创业板指数本季度上涨30.32%。在本季度,本产品维持了较高的仓位,个股也以中小市值个股为主,对净值有一定幅度贡献。

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1.437元,本报告期基金份额净值增长率为30.76%,同期业绩比较基准收益率13.68%,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

展望下一季度,我们认为,由于注册制即将推行的预期以及部分公司大股东可以减持的时间点来临,股票市场存在一定的风险,波动将会加大。我们将灵活控制仓位,并积极寻找新的主题性的投资机会。

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	权益投资	160,651,332.12	87.47
	其中:股票	160,651,332.12	87.47
2	固定收益投资	129,500.00	0.07
3	其中:债券	129,500.00	0.07
	资产支持证券	-	0.00
	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
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
	银行存款和结算备付金合计	19,716,217.44	10.73
7	其他资产	3,174,031.84	1.73
8	合计	183,671,081.40	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	102,290,476.88	57.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	18,685.00	0.01
F	批发和零售业	11,838,665.84	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,894,812.06	1.06
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,185,776.99	14.11
J	金融业	5,917,065.00	3.31
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	8,100,343.35	4.54
M	科学研究和技术服务业	3,447,243.00	1.93
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	1,958,264.00	1.10
S	综合	-	0.00
	合计	160,651,332.12	89.97

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	002662	京威股份	432,200	9,508,400.00	5.33
2	300059	东方财富	157,064	8,172,039.92	4.58
3	600303	曙光股份	504,000	7,736,400.00	4.33
4	600520	中发科技	273,800	7,633,544.00	4.28
5	002517	泰亚股份	118,699	7,186,037.46	4.02
6	002355	兴民钢圈	338,928	6,798,895.68	3.81
7	002730	电光科技	134,200	6,594,588.00	3.69
8	300298	三诺生物	179,698	6,461,940.08	3.62
9	002292	奥飞动漫	124,555	6,440,739.05	3.61
10	000001	平安银行	493,500	5,917,065.00	3.31

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	-	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	129,500.00	0.07
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	129,500.00	0.07

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	123001	蓝标转债	1,295	129,500.00	0.07

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 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

本基金投资的前十名证券之一广发证券,2015年8月26日因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为收到中国证券监督管理委员会调查通知书;2015年9月12日因未按照《证券登记结算管理办法》和《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》而收到中国证券监督管理委员会的《行政处罚事先告知书》。本基金认为,对中信证券的处罚及调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	509,620.79
2	应收证券清算款	1,795,300.40
3	应收股利	-
4	应收利息	4,403.58
5	应收申购款	864,707.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,174,031.84

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	128,985,275.32
报告期期间基金总申购份额	11,654,311.17
减:报告期期间基金总赎回份额	16,353,453.57
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	124,286,132.92

§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10月15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第六届董事会十次会议审议通过,周立新先生、温志敏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行业轮动股票型证券投资基金的文件;

2.《大成行业轮动混合型证券投资基金基金合同》;

3.《大成行业轮动混合型证券投资基金基金托管协议》;

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
2016年1月20日

大成核心双动力混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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:2016年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成核心双动力混合
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	33,412,372.33份
投资目标	以稳健的投资策略为主,采用合理的方法适当提升风险收