大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

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	大成产业升级股票 (LOF)
场内简称	大成产业
交易代码	160919
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2014年12月26日
报告期末基金份额总额	637,509,104.00份
投资目标	本基金重点投资于与产业升级主题相关的行业和企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会 实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×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。
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	83,611,127.33
2.本期利润	203,212,578.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.3092
4.期末基金资产净值	935,271,758.09
5.期末基金份额净值	1.467

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(不含公允价值变动损益)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。

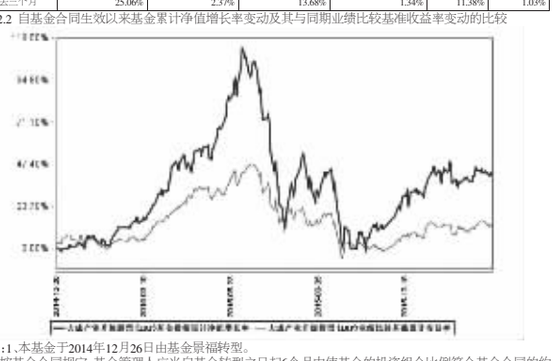
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	25.06%	2.37%	13.68%	1.34%	11.38%	1.03%

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:1.本基金于2014年12月26日由基金景福转型。

2.按基金合同规定,基金管理人应当自基金转型之日起6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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王文祥先生	本基金基金经理、研究部总监	2014年12月26日	-	8年	清华大学工学硕士,2007年7月至2014年3月任职于长城基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、基金经理助理及长城双动力股票型证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。2014年3月加入大成基金管理有限公司,现任研究部总监,2014年7月26日至2014年12月25日任景福证券投资基金基金经理,2014年12月26日起至2016年1月11日任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理,现兼任研究部总监和社保基金及机构投资部总监。具有基金从业资格,国籍:中国
李林益先生	本基金经理	2015年7月7日	-	4年	工学硕士,经济学学士,2011年6月加入大成基金管理有限公司,历任研究部研究员、基金经理助理,2015年7月7日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1.王文祥先生已于2016年1月11日离任本基金基金经理职务,上述事项已按法规要求及公司相关制度办理,变更流程合法合规。

2.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

3.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》、《大成产业升级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产业升级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4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

季度之初,受益于监管机构及时调整政策,市场恐慌情绪得以释放。前期下跌是的很多优质成长股出现了严重的价值低估,从而提供了很好的买点,基金自国庆前后开始积极加仓。到11月25日本轮反弹结束,期间阶段性收益33.50%,而同期基准14.49%。而此后,基金运作偏向于防御。

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1.467元,本报告期基金份额净值增长率为25.06%,同期业绩比较基准收益率为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

未来一段,经济面临更为严峻的考验,同样也面临着机会。在去产能的大主题下,我们仍将秉持审慎、负责的理念,顺势而为,寻找风险、收益匹配品种。

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	850,564,303.17	89.94
	其中:股票	850,564,303.17	89.94
2	固定收益投资	-	-
3	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
	银行存款和结算备付金合计	75,650,549.70	8.00
7	其他资产	19,520,533.38	2.06
8	合计	945,735,386.25	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	662,681,814.30	70.85
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	17,515,520.00	1.87
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	51,915,603.02	5.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,915,343.00	2.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	39,040,508.80	4.17
N	水利、环境和公共设施管理业	15,840,123.20	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	36,655,390.85	3.92
	合计	850,564,303.17	90.94

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	300367	东方网力	890,656	62,078,723.20	6.64
2	002384	东山精密	3,011,404	60,288,308.08	6.45
3	002414	高德红外	1,953,760	59,531,067.20	6.37
4	300342	天银机电	995,560	45,795,760.00	4.90
5	002380	科远股份	974,270	39,058,484.30	4.18
6	300384	三联虹普	463,664	39,040,508.80	4.17
7	000034	深信泰丰	1,311,463	36,655,390.85	3.92
8	300327	中颖电子	913,084	36,249,434.80	3.88
9	002456	欧菲光	1,043,100	32,356,962.00	3.46
10	002292	奥飞动漫	605,109	31,290,186.39	3.35

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

本基金为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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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	2,622,401.42
2	应收证券清算款	16,870,941.87
3	应收股利	-
4	应收利息	27,190.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,520,533.38

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	000034	深信泰丰	36,655,390.85	3.92	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

报告期初基金份额总额	712,538,812.16
报告期期间基金总申购份额	749,651.30
减:报告期期间基金总赎回份额	75,779,359.46
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	637,509,104.00

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,500,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	7,500,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.18

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产业升级股票型证券投资基金(LOF)的文件;

2.《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3.《大成产业升级股票型证券投资基金(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
2016年1月20日

大成丰财宝货币市场基金

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	139,340,669.91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,在风险与收益的配比中,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	74,100,426.64份	65,240,243.27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10月1日 - 2015年12月31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	646,338.97	491,975.04
2.本期利润	646,338.97	491,975.04
3.期末基金资产净值	74,100,426.64	65,240,243.27

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(不含公允价值变动损益)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

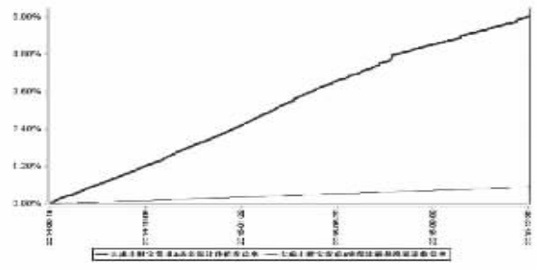
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7320%	0.0094%	0.0438%	0.0000%	0.6438%	0.0094%

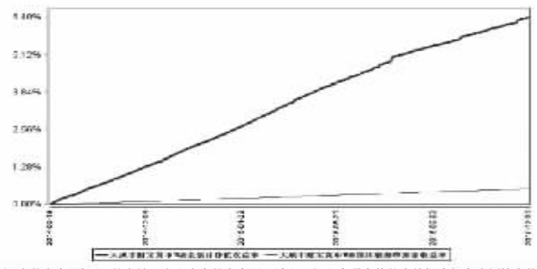
大成丰财宝货币B

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	0.7932%	0.0094%	0.0882%	0.0000%	0.7050%	0.0094%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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6月23日至2014年12月23日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理,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,任大成景明灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年5月4日起,任大成景慧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4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4季度在宽松货币政策和疲软基本面推动下,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最大,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,短融、存款收益率不断下滑。

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存款配置,同时积极参与波段操作,为组合获取了一定收益。

4.5 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0.7320%,B类净值收益率0.7932%,期间业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年1季度,我们认为债券市场整体风险可控,仍然处于牛市行情,权威人士在人民日报的供给侧改革专访中提到,在当前形势下,国民经济不可能通过短期刺激实现V型反弹,可能会经历一个L型增长阶段"。同时,2016年中央政府准备下大力气抓去产能、去库存,希望市场出清,在这个过程中,经济预计会出现比较痛苦的调整,经济增速的下滑压力会加大,需要货币政策和财政政策的呵护和对冲。另外,目前看汇率大幅贬值的趋势性因素是不存在的,阶段性的贬值可以通过下调准备金率实现对冲。整体我们仍然看好债券市场。

2016年1季度,我们将重点关注个券信用风险,提高入库标准,降低组合信用风险敞口,进一步加强流动性管理,增加组合操作灵活性,适度参与债券波段操作,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。

4.7 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	49,979,905.59	32.11
	其中:债券	49,979,905.59	32.11
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	54,600,521.90	35.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	50,153,290.34	32.22
4	其他资产	909,923.93	0.58
5	合计	155,643,641.76	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	10.59
	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	16,037,791.98 / 11.51
	其中:买断式回购融资	- / 0.00

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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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	60.82	11.51
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	7.17	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	7.18	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	7.18	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	28.70	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	111.05	11.51

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	9,994,932.57	7.17
	其中:政策性金融债	9,994,932.57	7.17
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	39,984,973.02	28.70
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	49,979,905.59	35.87
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

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	041556027	15长沙光导CP001	100,000	9,997,330.61	7.17
2	041559058	15天富CP001	100,000	9,996,982.32	7.17
3	011526003	15中金集SCP003	100,000	9,996,277.19	7.17
4	150403	15农发03	100,000	9,994,932.57	7.17
5	041551063	15联通CP001	100,000	9,994,382.90	7.17

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1745%
报告期内偏离度的最低值	0.1026%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1374%

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益。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	909,923.93
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	909,923.93

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	106,141,636.07	64,818,866.60
报告期期间基金总申购份额	61,902,786.86	5,490,396.18
减:报告期期间基金总赎回份额	93,943,996.29	5,069,019.51
报告期期末基金份额总额	74,100,426.64	65,240,243.27

§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财富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
2016年1月20日

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

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	2,402,138,706.82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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	208,377,518.30
2.本期利润	588,014,678.79