大成标普500等权重指数证券投资基金

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

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500等权重指数QDII
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23日
报告期末基金份额总额	34,272,035.33份
投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-

§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	1,321,917.37
2.本期利润	3,057,145.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0860
4.期末基金资产净值	49,342,400.60
5.期末基金份额净值	1.440

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	6.19%	1.09%	5.04%	1.18%	1.15%	-0.09%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	13年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部,任研究员;2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部,任高级研究员;2005年9月加入大成基金管理有限公司,历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起担任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起担任大成纳斯达克100指数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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《大成标普500等权重指数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,大成标普500等权重指数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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度,全球金融市场的整体表现较好,全球宏观经济增长速度相对稳定。

2015年4季度,欧洲及日本市场保持相对稳定,新兴市场虽然依然有所波动,但波动幅度不大。

2015年4季度,美国公布了3季度GDP终值,其3季度GDP年化环比增长率为2.0%,其中核心个人消费支出环比增长率为1.4%,这和美国近期就业市场复苏、消费支出增加相吻合。经济数据表明,美国依然保持着较为稳健的增长,但增长速度仍然低于潜在的经济增速。

12月份,美联储提高了联邦基金目标利率25bp,这标志着美联储新一轮加息周期开启,也符合市场预期,同时美联储也暗示未来循序渐进的加息路径,未来加息进程仍旧取决于经济数据。当前美国通胀率仍然明显地低于2%的通胀目标,但对通胀率在未来有望得以上升。

美联储加息的靴子落地后,股票市场的不确定有所减弱,因此促进了美国股票市场的上涨,本基金的基准指数在4季度也有明显涨幅。同期,美元相对人民币持续升值,这也对本基金净值产生正面影响。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨5.04%,美元兑人民币中间价上涨2.08%,经汇率调整后的目标指数上涨7.22%。在本报告期内,本基金净值上涨6.19%,高于经汇率调整后的目标指数-1.03%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.16%,日均偏差绝对值为0.05%,均显著低于本基金合同中的目标值。

4.5.2 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1.440元,本报告期基金份额净值增长率为6.19%,同期业绩比较基准收益率为5.04%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,在宽松货币政策支持下,欧元区和日本经济预计将继续恢复,增速预计与2015年持平。

2016年,美国经济有望延续温和扩张的态势,但经济增速可能会持续低于潜在增长速度。介于劳动力市场的持续好转及通胀可能的提升,美联储可能有2次左右的加息操作,但加息不会对宏观经济造成严重的负面影响。

2016年,美元指数或将保持强势,美元相对于人民币有望继续保持升值的趋势,这将持续有利于本基金净值的表现。

2015年本指数成分股企业盈利增速动力大幅减弱,进入2016年后,企业盈利有望恢复增长,但增速或许不会太高。当前标普500指数的动态市盈率在17倍左右,仍然处于历史平均区间内。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,持续实施高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好的跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	46,407,281.66	92.78
	其中:普通股	46,407,281.66	92.78
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
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	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	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	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	3,474,764.33	6.95
8	其他资产	139,136.17	0.28
9	合计	50,021,182.16	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	46,407,281.66	94.05
合计	46,407,281.66	94.05

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	8,254,942.52	16.73
消费者非必需品	7,634,387.05	15.47
信息技术	6,315,752.59	12.80
工业	6,057,403.71	12.28
医疗保健	5,279,363.75	10.70
能源	3,690,992.88	7.48
消费者常用品	3,463,099.58	7.02
公用事业	2,803,486.94	5.68
基础材料	2,428,120.54	4.92
电信服务	479,732.10	0.97
合计	46,407,281.66	94.05

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	美国	272	116,555.44	0.24
2	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	美国	705	112,893.18	0.23
3	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	美国	2,429	112,145.71	0.23
4	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	美国	1,413	107,995.13	0.22
5	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	纽约交易所	美国	164	107,783.63	0.22
6	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	美国	303	105,402.23	0.21
7	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	美国	2,050	105,163.85	0.21
8	General Growth Properties Inc	通用增长物业公司	GGP UN	纽约交易所	美国	589	104,070.91	0.21
9	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	美国	109	103,572.73	0.21
10	Simon Property Group A	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约交易所	美国	82	103,534.48	0.21

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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。

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的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	63,306.30
4	应收利息	103.07
5	应收申购款	75,726.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,136.17

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

5.10.5.1 报告期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资的股票及存托凭证。

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	36,692,623.02
报告期期间基金总申购份额	2,425,890.56
减:报告期期间基金总赎回份额	4,846,478.25
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	34,272,035.33

§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

基金管理人本报告期末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标普500等权重指数证券投资基金的文件;

2、《大成标普500等权重指数证券投资基金基金合同》;

3、《大成标普500等权重指数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

大成财富管理2020生命周期证券投资基金

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2020生命周期混合
交易代码	090006
前端交易代码	090006
后端交易代码	091006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月13日
报告期末基金份额总额	3,741,509,957.00份
投资目标	本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和(或)货币市场工具等,通过调整资产配置策略和精选证券,以超越业绩比较基准,寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在2020年12月31日以前,本基金侧重于资本增值,当期收益为辅;在2020年12月31日之后,本基金侧重于当期收益,资本增值为辅。
投资策略	本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化,将纪律性和科学性结合起来,建立较全面的资产、个券投资价值评价体系,不断优化投资组合配置。本基金的投资策略分为两个层次:第一个层次是资产配置策略,即在权益类、固定收益类证券和货币市场工具之间的配置比例;第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。
业绩比较基准	基金合同生效日至2010年12月31日:75%×新华富时中国A600指数+25%×中国债券总指数 2011年1月1日至2015年12月31日:45%×沪深300指数+55%×中国债券总指数 2016年1月1日至2020年12月31日:25%×沪深300指数+75%×中国债券总指数 2021年1月1日以及该日以后:10%×沪深300指数+90%×中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于生命周期型基金,2020年12月31日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日止,本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低,即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票基金;随着目标日期的临近,本基金逐步发展为一只低风险债券型基金。
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

§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	220,604,191.50
2.本期利润	461,006,419.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1213
4.期末基金资产净值	3,131,588,329.47
5.期末基金份额净值	0.837

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。

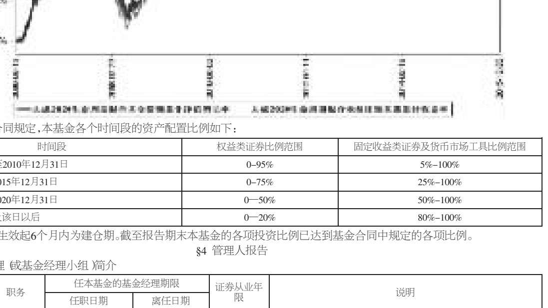
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	16.74%	1.54%	9.16%	0.75%	7.58%	0.79%

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:按基金合同规定,本基金各个时间段的资产配置比例如下:

时间段	权益类证券比例范围	固定收益类证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至2010年12月31日	0-95%	5%-100%
2011年1月1日至2015年12月31日	0-75%	25%-100%
2016年1月1日至2020年12月31日	0—50%	50%-100%
2021年1月1日以及该日以后	0—20%	80%-100%

自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§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		
周德昕	本基金基金经理	2014年6月26日	-	13年	财务管理学硕士。曾任职于哈里投资有限公司、新疆证券有限责任公司及广发证券股份有限公司,从事投资研究工作。2007年3月至2012年3月任职于招商基金管理有限公司,历任高级研究员、研究组长、助理基金经理及招商大盘蓝筹股票型证券投资基金及招商中小盘精选股票型证券投资基金基金经理。2012年4月至2014年4月任职于安信证券股份有限公司,历任证券投资部执行总经理及资产管理部副总经理。2014年4月加入大成基金管理有限公司,现任股票投资部成长组投资总监。2014年6月26日起任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2015年5月23日至2015年7月2日任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理,2015年7月3日起任大成新锐产业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》、《大成财富管理2020生命周期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,大成财富管理2020生命周期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

第四季度,宏观经济仍无起色,尽管保增长不断,但也属于市场预期中;货币政策进一步放松,使得市场流动性仍较为充裕;加上监管政策对市场的不断呵护,叠加经过股灾后的部分股票估值趋于合理,市场出现明显的反弹,前两个月以新兴产业为主,12月份由于保险的举牌,国企大盘股出现明显的上涨。正如我们在半年报、第三季报的分析,我们一定能从股灾中走出来。

第四季,我们主要围绕国企改革、先进制造业、文化娱乐行业做了布局,且对不少个股做了波段,同时鉴于对年后市场震荡的格局和本基金产品契约的规定的判断,在12月份,我们对股票仓位做了大幅度的减仓。

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0.837元,本报告期基金份额净值增长率为16.74%,同期业绩比较基准收益率为9.16%,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2016年,全球视野看,预计是比2015年更为困难的一年,从宏观经济来看,国内经济难有起色,尽管我们寄希望于供给侧改革能给中长期的经济增长打好基础,但当前阶段,我们不得不面临改革的巨大代价;另外,从流动性的角度看,存在内交外困的局面,具体而言,美元的走强和人民币的走弱在中长期都将是一种趋势,外汇干预政策也出现了明显的改变,人民币贬值预期将始终压制市场。从内部而言,出现了一个非常大的变化,从新年最高当局的表态来看,宽松的货币环境似乎不会再出现,至多是稳健的货币政策,这在边际上是很大的变化。

从股市的供求情况看,鉴于去年下半年以来不断累高的减持堰塞湖,目前仍无非常好的处理办法。加上一级市场、一级半市场对注册制加快的预期和监管对并购重组的积极鼓励,预计再融资的增量会在上半年形成一个高潮,股票供给又会大比例增加。加上IPO也将加大供给。供求失衡的局面会阶段性出现。

因此,我们预计2016年的股票市场将难有好的表现,去年预期的资产配置荒将可能没那么明显,但结构性、阶段性机会是存在的。2016年度机会是阶段性、局部性的,围绕这两点,我们的打法将是精选个股、波段操作。另外由于本基金的固定收益仓位大幅提高,我们也将在这个领域做出更大的努力。

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	1,509,836,155.39	47.59
	其中:股票	1,509,836,155.39	47.59
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	296,433,720.00	9.34
	其中:债券	296,433,720.00	9.34
	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	229,800,614.70	7.24
	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	1,101,830,731.20	34.73
8	其他资产	34,896,436.18	1.10
9	合计	3,172,797,657.47	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	219,794,994.90	7.02
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	803,154,542.09	25.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,442,729.49	1.10
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	1,579,507.00	0.05
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	562,851.12	0.02
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	111,176,769.12	3.55
L	租赁和商务服务业	153,660,334.04	4.91
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	143,930,586.59	4.60
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	41,533,841.04	1.33
S	综合	-	0.00
	合计	1,509,836,155.39	48.21

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	000826	启迪桑德	3,462,931	137,201,326.22	4.38
2	600887	伊利股份	8,129,527	133,568,128.61	4.27
3	002449	国星光电	7,825,250	132,246,725.00	4.22
4	600565	迪马股份	9,518,559	111,176,769.12	3.55
5	600108	亚盛集团	13,099,965	96,153,743.10	3.07
6	600415	小商品城	9,923,952	91,201,118.88	2.91
7	002507	涪陵榨菜	3,835,503	71,992,391.31	2.30
8	601118	海南橡胶	9,355,380	70,726,672.80	2.26
9	000061	农产品	3,530,764	62,459,215.16	1.99
10	601058	赛轮金宇	6,513,790	58,624,110.00	1.87

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	50,650,000.00	1.62
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	219,857,000.00	7.02
	其中:政策性金融债	219,857,000.00	7.02
4	企业债券	5,371,500.00	0.17
5	企业短期融资券	20,184,000.00	0.64
6	中期票据	-	0.00
7	可转债(可交换债)	371,220.00	0.01
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	296,433,720.00	9.47

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	150208	15国开08	900,000	94,401,000.00	3.01
2	150220	15国开20	500,000	51,240,000.00	1.64
3	150026	15附息国债26	500,000	50,650,000.00	1.62
4	150218	15国开18	400,000	42,008,000.00	1.34
5	140229	14国开29	300,000	32,208,000.00	1.03

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内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	1,426,467.17
2	应收证券清算款	28,386,272.87
3	应收股利	-
4	应收利息	5,018,626.19
5	应收申购款	65,069.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,896,436.18

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	601058	赛轮金宇	58,624,110.00	1.87	重大事项停牌
2	600565	迪马股份	111,176,769.12	3.55	临时停牌

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	3,854,718,234.46
报告期期间基金总申购份额	32,368,931.49
减:报告期期间基金总赎回份额	145,577,208.95
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	3,741,509,957.00

§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

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财富管理2020生命周期证券投资基金的文件;

2、《大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金合同》;

3、《大成财富管理2020生命周期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

大成策略回报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:中国光大银行股份有限公司
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	大成策略回报混合
交易代码	090007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月26日
报告期末基金份额总额	259,048,764.66份
投资目标	追求基金资产的长期稳健增值,兼顾当期收益;同时,实施积极的分红政策,回报投资者。
投资策略	本基金在控制风险的前提下,采取趋势投资策略进行总体资产配置;在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略,以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益;同时,强调收益管理,实施收益管理策略,以期在增长期及时锁定收益,制度性的减少未来可能的下跌风险,增加投资收益。
业绩比较基准	80%×沪深300 指数+20%×中债综合指数
风险收益特征	本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种,其长期平均的预期收益和风险低于股票基金,高于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	中国光大银行股份有限公司

§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	11,600,158.48
2.本期利润	79,492,638.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.2973
4.期末基金资产净值	473,362,574.88
5.期末基金份额净值	1.827

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。

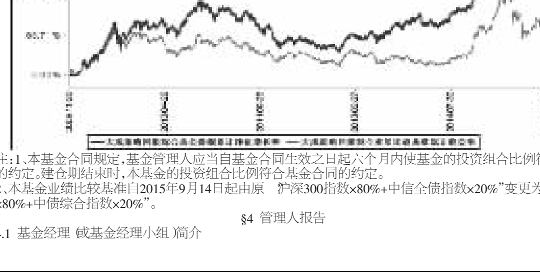
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	18.79%	1.77%	13.75%	1.34%	5.04%	0.43%

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、本基金业绩比较基准自2015年9月14日起由原"沪深300指数×80%+中信全债指数×20%"变更为"沪深300指数×80%+中债综合指数×20%"。

§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	2012年10月31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,曾任中游制造行业研究主管,2011年7月29日至2012年10月27日曾任景宏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日起任大成策略回报股票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

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》、《大成策略回报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,大成策略回报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

四季度的市场类似上半年。各种新方向层出不穷,市场亢奋,仿佛历史未曾发生。宝万之争也值得回顾,因为万科是另一类股票的代表,更因为事件反映的不同利益、商业道德以及价值观之间的争论。报告期内本基金操作很少。在九月份本人管理基金满三年之际,从风险收益比的角度看,为持有人创造了性价比较高的收益,这使得本人更敢于在未来坚持自己一贯的投资理念——价值投资,虽然这个词目前显得那么不合时宜。报告期内本人研究了一些新产业的公司,产业方向无可置疑,但无法粗暴的对应到股票;在这一类股票中有极少数符合我的理念,但错过了,这值得我深刻反省:该下重注时要勇于冒险,稳定性和灵活性之间并不矛盾。

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1.827元,本报告期基金份额净值增长率为18.79%,同期业绩比较基准收益率为13.75%,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

经济转型升级的主线不会改变,资金杠杆对市场的短期影响巨大,但市场可能放大了它的长期影响,很多小而美的公司渐渐进入价值区间。经过过去三年,尤其是过去大半年,本基金更坚定了投资理念:以判断企业价值为出发点,研究行业趋势、商业模式和管理团队,在显著低估或高估时坚定自己的信念。本基金相信,在当前价位买入持有和经济转型升级密切相关的优秀公司,能为持有人创造长期稳定的回报。

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	368,905,858.39	77.13
	其中:股票	368,905,858.39	77.13
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	109,080,913.01	22.81
8	其他资产	318,496.33	0.07
9	合计	478,305,267.73	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	191,574.90	0.04
B	采矿业	19,503,439.60	4.12
C	制造业	277,000,433.84	58.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,945.94	0.02
E	建筑业	570.95	0.00
F	批发和零售业	54,327,011.90	11.48
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	4,452,447.34	0.94
J	金融业	4,567.10	0.00
K	房地产业	7,737.34	0.00
L	租赁和商务服务业	15,435.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,457,359.68	2.42
N	水利、环境和公共设施管理业	96.80	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	1,872,237.60	0.40
S	综合	-	0.00
	合计	368,905,858.39	77.93

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	002126	银轮股份	2,358,808	43,520,007.60	9.19
2	002138	顺络电子	2,981,201	42,780,234.35	9.04
3	002422	科伦药业	2,166,982	40,305,865.20	8.51
4	002588	史丹利	1,169,066	38,029,716.98	8.03
5	002475	立讯精密	1,053,211	33,650,091.45	7.11
6	600885	宏发股份	1,108,017	33,118,628.13	7.00
7	600998	九州通	1,682,674	32,980,410.40	6.97
8	601933	永辉超市	2,112,535	21,336,603.50	4.51
9	600759	洲际油气	2,262,580	19,503,439.60	4.12
10	000333	美的集团	537,828	17,651,514.96	3.73

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金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科伦药业,2015年1月29日因涉嫌"未按照规定披露临时报告"收到中国证券监督管理委员会四川监管局《行政处罚事先告知书》,2015年2月25日因涉嫌"违反银行间市场相关自律规则指引"收到中国银行间市场交易商协会《非金融企业债务融资工具市场自律处分意见书》,2015年4月23日因涉嫌"未按照规定披露临时报告"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》。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	180,336.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,764.45
5	应收申购款	115,395.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,496.33

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	600759	洲际油气	19,503,439.60	4.12	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	276,427,058.97
报告期期间基金总申购份额	12,226,521.21
减:报告期期间基金总赎回份额	29,604,815.52
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	259,048,764.66

§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

本基金管理人本报告期末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策略回报混合型证券投资基金的文件;

2、《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成策略回报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