# 大成纳斯达克100指数证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7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7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成纳斯达克100指数(QDII) |
| 交易代码 | 000834 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年11月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,366,887.00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。<br>本基金可能将一定比例的基金资产投资于以纳斯达克100指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品,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 | 纳斯达克100价格指数 |
| 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 | 中国农业银行股份有限公司 |

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 | The Bank of New York Mellon Corporation |
| | 中文 | 纽约梅隆银行股份有限公司 |
| 注册地址 | | One Wall Street New York,NY10286 |
| 办公地址 | | One Wall Street New York,NY10286 |
| 邮政编码 | | NY10286 |

§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(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 23,288.45 |
| 2.本期利润 | 17,154.30 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0017 |
| 4.期末基金资产净值 | 11,561,030.33 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.115 |

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。

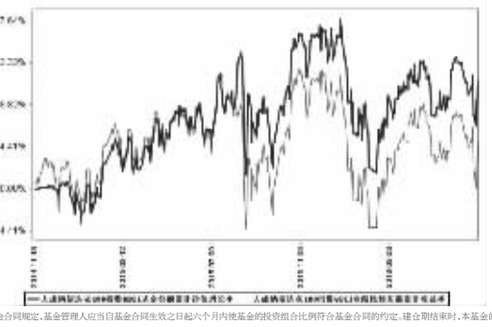
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 0.00% | 0.98% | -1.47% | 1.08% | 1.47% | -0.10% |

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 | 2014年11月13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

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 投资均为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》、《大成纳斯达克100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,大成纳斯达克100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。2016年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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不存在同日反向交易;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

2016年2季度,国际经济局势有较大变动,4月底,英国举行公投,其结果为“脱离欧盟”,公投结果公布后,对全球金融市场造成了较大的动荡,各大股票市场都出现了明显的短期下跌,但美国股票市场的跌幅随后又得以回复。

对于全球经济而言,由于英国退欧的过程较为漫长和复杂,因此其确切的影响较难估算,但就中长期而言,如果由退欧这一政治事件对英国和欧盟的经济政策所产生的不确定性不断发酵,则英国与欧盟的投资将持续受到抑制,其未来经济的复苏也将更加步履维艰。

2季度,美国宏观经济表现较为平淡,但仍保持在增长的轨道上。美国一季度GDP环比年化增长率为1.1%,低于此前的三个季度,但其是近三年来一季度GDP增速中最高值。

美国一季度GDP保持增长的原因是,企业投资、居民消费、容建支出和商品贸易都保持增长。同时,因就业率维持高位,居民收入大幅上升,而通胀维持低位,消费支出低于收入增速,美国储蓄率上升至近年来最高水平,即使在英国进出欧盟过程中,美国经济受到的影响也相对较小。

由于英国“退欧”事件,美联储对于加息表现更为审慎,当前预计2016年仅还有一次加息机会,虽然加息预期降低,但由于欧洲不稳定性增强,因此美元预计仍会保持强势。

2季度,美元相对于人民币继续保持升值的趋势,这有利于本基金净值的表现。

在本报告期内,本基金的目标指数下跌1.47%,美元兑人民币中间价上涨2.63%,本基金净值基本持平,在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.80%,日均偏差绝对值为0.0189%,均显著低于本基金合同中的目标值。

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,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.115元,本报告期基金份额净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准收益率为-1.47%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内,曾于2016年4月1日至2016年6月30日出现了连续60个工作日资产净值低于五千万元的情形。本基金已按法律法规相关规定向中国证监会报告清盘解决方案,本基金管理人后续将根据法规规定对该事项的最新进展进行信息披露。

§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 | 10,650,615.96 | 88.32 |
| | 其中:普通股 | 10,650,615.96 | 88.32 |
| | 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 | 876,867.58 | 7.27 |
| 8 | 其他资产 | 531,142.29 | 4.40 |
| 9 | 合计 | 12,058,625.83 | 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 | 10,650,615.96 | 92.13 |
| 合计 | 10,650,615.96 | 92.13 |

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(%) |
|---|---|---|
| 信息技术 | 5,972,662.11 | 51.66 |
| 消费者非必需品 | 2,353,241.72 | 20.35 |
| 医疗保健 | 1,280,245.00 | 11.07 |
| 消费者常用品 | 790,178.64 | 6.83 |
| 工业 | 201,689.28 | 1.74 |
| 电信服务 | 52,599.21 | 0.45 |
| 金融 | 0.00 | 0.00 |
| 能源 | 0.00 | 0.00 |
| 公用事业 | 0.00 | 0.00 |
| 基础材料 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 10,650,615.96 | 92.13 |

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 | Apple Inc. | 苹果公司 | AAPL UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 1,766 | 1,119,542.84 | 9.68 |
| 2 | Microsoft Corp | 微软公司 | MSFT UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 2,535 | 860,172.41 | 7.44 |
| 3 | Amazon.com Inc | 亚马逊公司 | AMZN UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 152 | 721,303.74 | 6.24 |
| 4 | Facebook Inc A | Facebook公司 | FB UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 745 | 564,571.08 | 4.88 |
| 5 | Alphabet Inc C | Alphabet公司 | GOOGL UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 110 | 504,839.89 | 4.37 |
| 6 | Alphabet Inc A | Alphabet公司 | GOOGL UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 94 | 438,533.32 | 3.79 |
| 7 | Comcast Corp A | 康卡斯特 | CMCSA UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 779 | 336,752.30 | 2.91 |
| 8 | Intel Corp | 英特尔公司 | INTC UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 1,523 | 331,257.62 | 2.87 |
| 9 | Cisco Systems Inc | 思科公司 | CSCO UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 1,622 | 308,584.09 | 2.67 |
| 10 | Amgen Inc | 安进公司 | AMGN UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 242 | 244,162.77 | 2.11 |

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 | 3,791.12 |
| 4 | 应收利息 | 20.46 |
| 5 | 应收申购款 | 393,982.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 133,348.26 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 531,142.29 |

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 | 11,133,578.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,052,906.12 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,819,597.48 |
| 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 | 10,366,887.00 |

§7 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未运用固有资金投资本基金。

§8 影响影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§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纳斯达克100指数证券投资基金的文件;

2.《大成纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》;

3.《大成纳斯达克100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7月20日

# 大成灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7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7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成灵活配置混合 |
| 交易代码 | 000587 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年5月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 186,737,265.26份 |
| 投资目标 | 本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理,拓展大类资产配置空间,在精选个股、个券的基础上适度集中投资,在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析,研判经济周期在宏观投资环境理论所处的阶段,综合评价各类资产的市场趋势,预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。 |
| 业绩比较基准 | 年化收益率6% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。 |
| 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(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -9,067,839.62 |
| 2.本期利润 | 7,751,775.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0404 |
| 4.期末基金资产净值 | 348,798,004.70 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.868 |

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。

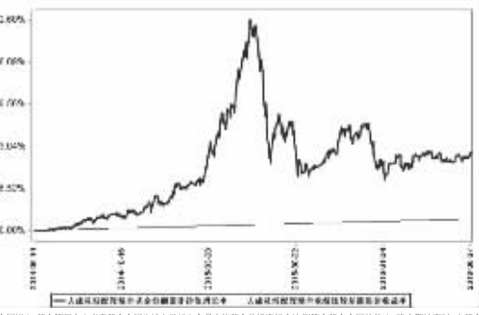
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 2.30% | 1.19% | 1.34% | 0.01% | 0.96% | 1.18% |

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 | | |
| 孙蓓琳女士 | 本基金基金经理 | 2015年9月29日 | - | 12年 | 经济学硕士,2004年7月至2007年7月就职于银华基金管理有限公司,历任宏观研究员、行业研究员,2007年7月加入大成基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理、研究部副总监,2012年7月28日至2014年1月29日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理,2012年12月18日至2015年7月2日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理,2015年7月3日起任大成积极成长混合型证券投资基金基金经理,2015年9月29日起任大成灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任投资总部混合组投资总监,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 管理人对投资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》、《大成灵活配置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,大成灵活配置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。2016年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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不存在同日反向交易;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 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度市场出现了明显的结构性行情,虽然上证指数下跌2.47%,创业板指数下跌0.47%,但是白酒、有色、家电等板块涨幅较大,行业结构分化加大。本基金在2季度对组合进行了调整,增加了食品饮料板块的配置,并且自下而上精选了一些产业成长股,积极成长2季度净值增长3.88%,跑赢业绩基准5.35个百分点;大成灵活配置2季度净值增长2.30%,跑赢业绩基准0.82个百分点。

4.5 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1.868元,本报告期基金份额净值增长率为2.30%,同期业绩比较基准收益率为1.34%,高于业绩比较基准的表现。

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 | 292,542,025.59 | 82.54 |
| | 其中:股票 | 292,542,025.59 | 82.54 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 356,853.60 | 0.10 |
| | 其中:债券 | 356,853.60 | 0.10 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 54,650,522.60 | 15.42 |
| 8 | 其他资产 | 6,868,905.07 | 1.94 |
| 9 | 合计 | 354,418,306.86 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 9,446,128.73 | 2.71 |
| B | 采矿业 | 3,537,779.30 | 1.01 |
| C | 制造业 | 182,934,145.58 | 52.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 168,761.64 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 56,032,247.99 | 16.06 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 18,485,380.25 | 5.30 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,126.10 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 10,758,464.00 | 3.08 |
| 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 | 11,158,992.00 | 3.20 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 292,542,025.59 | 83.87 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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 | 600887 | 伊利股份 | 1,304,600 | 21,747,682.00 | 6.24 |
| 2 | 000963 | 华东医药 | 309,448 | 20,856,795.20 | 5.98 |
| 3 | 000078 | 海王生物 | 2,292,753 | 17,035,154.79 | 4.88 |
| 4 | 000892 | 星美联合 | 1,058,879 | 14,983,137.85 | 4.30 |
| 5 | 002640 | 跨境通 | 846,000 | 14,906,520.00 | 4.27 |
| 6 | 600867 | 通化东宝 | 702,120 | 14,526,862.80 | 4.16 |
| 7 | 000835 | 长城动漫 | 802,532 | 11,355,827.80 | 3.26 |
| 8 | 300072 | 三聚环保 | 405,872 | 11,218,302.08 | 3.22 |
| 9 | 300364 | 中文在线 | 214,596 | 11,158,992.00 | 3.20 |
| 10 | 002672 | 东江环保 | 620,800 | 10,758,464.00 | 3.08 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 356,853.60 | 0.10 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 356,853.60 | 0.10 |

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 | 132003 | 15清控EB | 3,240 | 356,853.60 | 0.10 |

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 231,027.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,549,770.21 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 14,021.36 |
| 5 | 应收申购款 | 74,085.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,868,905.07 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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 | 000835 | 长城动漫 | 11,355,827.80 | 3.26 | 重大资产重组 |
| 2 | 002672 | 东江环保 | 10,758,464.00 | 3.08 | 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 202,987,876.53 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,102,226.68 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 21,352,837.95 |
| 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 | 186,737,265.26 |

§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

注: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

注: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

基金管理人于2016年6月25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十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§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灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2.《大成灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《大成灵活配置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

备查文件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7月20日

# 大成蓝筹稳健证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7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7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成蓝筹稳健混合 |
| 交易代码 | 090003 |
| 前端交易代码 | 090003 |
| 后端交易代码 | 091003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年6月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,042,267,874.01份 |
| 投资目标 | 通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制非系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产的中长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略(CPPI)来动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例;行业配置采取较为积极的策略,以投资基准的行业权重为基础,以行业研究及比较分析为核心,通过适时增大或降低相应行业的投资权重,使整体投资表现跑上或超越投资基准;个股选择策略则采用蓝筹成分较优选策略,运用“价值—势头”选股方法,优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资;债券投资采用完全积极的投资策略,采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 天相280指数×70%+中债综合指数×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期风险与收益水平低于股票型基金,高于债券型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 | 中国银行股份