
大成中國人民幣固定收益基金

大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

中期報告

截至二零一五年六月三十日止期間





大成投資信託基金
二零一五年一月一日截至二零一五年六月三十日止期間

中期報告

目錄

頁碼

基金管理和基金行政	1
基金經理致基金單位持有人報告	2-3
財務狀況報表（未經審計）	4-5
全面收入報表（未經審計）	6-7
基金單位持有人應佔資產淨值變動報表（未經審計）	8-9
大成中國人民幣固定收益基金	10-14
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	
大成中國靈活配置基金	15-33
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	

大成投資信託基金
截至二零一五年六月三十日止期間

基金管理和基金行政

基金經理董事

曹雄飛(於二零一四年十一月十九日辭職)
陳尚前(於二零一四年十一月十九日辭職)
劉彩暉(於二零一四年一月十二日辭職)
楊春明(於二零一五年三月十日辭職)
鄧韶勇先生
杜鵬女士
肖冰先生
邱瑾女士(於二零一四年十一月十九日委任)
鐘鳴遠先生(於二零一四年十一月十九日委任)
羅登攀先生(於二零一五年三月十日委任)

基金經理

大成國際資產管理有限公司
香港中環
康樂廣場1號
怡和大廈35樓
3516-3519室

託管人

中國銀行(香港)有限公司
香港中環花園道1號
中銀大廈14樓

中國分託管人

中國銀行股份有限公司
中國北京(郵政編碼: 100818)
復興門內大街1號

受託人及過戶登記處

中銀國際英國保誠信託有限公司
香港銅鑼灣威非路道18號
萬國寶通銀行中心12及25樓

基金經理法律顧問

西盟斯律師行
香港中環金鐘道88號
太古廣場一期13樓

中國投資顧問

大成基金管理有限公司
中國深圳市(郵政編碼: 518040)
福田區深南大道7088號
招商銀行大廈32樓

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港中環皇后大道中15號
公爵大廈21樓



基金經理致基金單位持有人報告

大成中國人民幣固定收益基金 (大成投資信託基金的子基金)

基金表現

大成中國人民幣固定收益基金旨在獲取穩定的利息回報和資本增長，截至二零一五年六月三十日，大成中國人民幣固定收益基金的RMB Class A每單位資產淨值為人民幣10.11元，USD Class I每單位資產淨值為美元10.36元，累計總資產規模為人民幣996,751,269元。

市場回顧

本基金2015年上半年共取得了1.30%的正回報，同时对投资者每份份额进行了0.13元的分红。本基金的组合以AAA评级的高等级信用债为主，同时本基金还持有一定比例的政策性金融债。以高等级信用债为主的组合配置反映了本基金主要通过债券的票息获取持续稳定回报的投资目标。

2015年上半年，经济增长持续较弱，1、2季度的GDP同比增速均为7%，明显低于2014年的经济增长水平。随着有可能经济下行压力的增大，通胀位于相对低位，宏观政策迎来实质性放松，央行通过降准、降息和公开市场操作等方式推动货币端的宽松，使得今年上半年国内债市迎来了一轮牛市行情。

展望2015年下半年，稳增长力度有望进一步加大，经济能否企稳取决于刺激政策的实施效果，房地产投资能否企稳是下半年经济面临的主要风险。受宏观环境不景气、不良贷款压力上升的影响，银行的风险偏好难以明显提升，利率传导不畅，企业仍然面临融资难、融资贵的问题，预计政策仍将保持一定的刺激力度，有望从“宽货币”转向“宽货币、宽信用、宽财政”的全面刺激。在这样的宏观环境下，我们认为下半年债市整体风险不大。在投资策略方面，组合仍将坚持以高等级、期限在3年以内的信用债为主的策略，降低债市波动对净值的影响，同时也尽量降低经济下行周期的信用风险对组合的影响。在此基础上，通过积极的久期管理，提高组合的回报。

基金經理致基金單位持有人報告

大成中國靈活配置基金 (大成投資信託基金的子基金)

基金表現

大成中國靈活配置基金旨在尋求資本及收入長遠增長，截至二零一五年六月三十日，大成中國靈活配置基金的RMB Class A每單位資產淨值為人民幣15.39元，USD Class A每單位資產淨值為美元15.17元，HKD Class A每單位資產淨值為港幣15.15元，累計總資產規模為人民幣1,116,999,034元。

市場回顧

2015年上半年中國經濟持續放緩，但受持續政策放鬆影響，市場利率與實際利率大幅下行帶動風險偏好提升，杠杆資金蜂擁入市推動估值擴張。2015年上半年，股市和債市都出現了估值重估的投資機會。截至2015年6月30日，本基金上半年的人民幣份額累計收益為18.74%。期內本基金收益率可觀，得益於股票市場與債券市場風險均衡化。

展望2015年下半年，我們預計經濟溫和復蘇，貨幣政策持續寬鬆。我們預期本年三、四季度GDP同比增速達到7%以上，消費、投資和外需環比增長有望同步溫和加速。消費方面，在可選消費進一步復蘇的推動下，下半年社會消費品零售總額增速可能有所加速。固定投資方面，隨著融資成本的下降及財政政策更有效的執行，基建投資、製造業投資及房地產投資需求均可能在第三季度末出現改善跡象。外需方面，鑒於美日歐三大經濟體的領先指標正在走強，外需下半年有望企穩回升。

另外，在資本市場方面，我們預計下半年股票市場的波動率可能較上半年大幅提升，基於以下原因：1) 實體經濟仍未出現明顯的企穩跡象；2) 估值修復的過程已基本結束，部分成長股和創業板股票估值過高；3) 經歷6月底暴跌後，風險偏好大幅降低，加上去杠杆過程持續，證監會將有可能持續採取措施控制融資融券及場外配資交易。

我們2015年下半年的投資策略將偏於保守。在資產配置中，為降低組合的波動性，我們將下調股票的持有比重，增長固定收益的持有占比。在行業配置方面，高配環保、消費、航空和醫藥，相對低配石油石化、科技硬體。總而言之，我們將更專注於股票選擇，以達到降低風險同時獲得更高收益的目的。

大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

財務狀況報表(未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	大成中國人民幣固定收益基金	
	二零一五年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零一四年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	254,629	271,149
流動資產		
投資	947,895,159	981,451,402
應收利息	18,655,193	28,787,711
預付款與其他資產	38,340	6,656
現金及現金等價物	49,922,851	19,285,386
總資產	<u>1,016,766,172</u>	<u>1,029,802,304</u>
負債		
非流動負債		
遞延所得稅負債	1,420,773	1,025,305
流動負債		
應付管理費用	691,454	736,539
應付贖回款	2,244,315	222,417
預提費用及其他應付款	305,246	285,940
應付派息	9,660,689	5,010,442
預提稅款準備金	5,692,426	5,247,172
總負債(二零一四年：不包括基金單位持有人應佔資產淨值)	<u>20,014,903</u>	<u>12,527,815</u>
基金單位持有人應佔資產淨值(在建立成本攤銷之前)	996,751,269	1,017,274,489
就基金導致單位持有人應佔資產淨值所採納的不同基準作出調整	-	65,966
基金單位持有人應佔資產淨值(附注)	<u>996,751,269</u>	<u>1,017,340,455</u>

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

財務狀況報表(未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	大成中國靈活配置基金	
	二零一五年六月三十日	二零一四年十二月三十一日
	(未經審計) 人民幣	(經審計) 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	195,244	26,684
流動資產		
按公平價值透過損益記賬的金融資產	970,160,979	227,304,312
應收利息	421,413	37,948
應收申購款	40,633,931	15,958,427
預付款與其他資產	73,420	359,316
現金及現金等價物	128,853,598	26,217,476
存放經紀處款項	18,275,165	19,998,535
總資產	1,158,613,750	289,902,698
負債		
非流動負債		
遞延所得稅負債	58,899	761
流動負債		
以公平價值透過當期損益記賬的負債	-	4,681,440
應付管理費用	1,267,430	376,047
應付贖回款	27,041,554	9,030,761
預提費用及其他應付款	2,389,052	451,877
應付派息	10,540,366	1,888,621
預提稅款準備金	317,415	277,316
總負債(不包括基金單位持有人應佔資產淨值)	41,614,716	16,706,823
基金單位持有人應佔資產淨值	1,116,999,034	273,195,875

大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

綜合收益表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	大成中國人民幣固定收益基金	
	自二零一五年一月一日至 二零一五年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零一四年一月一日至二零一 四年十二月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
收益		
股息收入	-	234,118
利息收益	22,573,934	40,609,868
投資淨收益/(虧損)	11,324,503	11,330,034
匯兌收益	27,320	904,008
總投資收益	33,925,757	53,078,028
開支		
管理費用	3,961,278	7,168,974
應付受託人費用	696,721	1,252,758
託管費	371,675	650,318
初始設立費用	65,966	-
交易買賣費用	98,795	206,575
核數師酬金	91,682	147,277
其他費用	124,115	232,789
總經營支出	5,410,232	9,658,691
對基金單位持有人的分派利潤	(12,594,112)	(17,249,310)
利潤分派後及稅前利潤	15,921,413	26,170,027
稅項	(888,219)	(5,043,906)
利潤分派後及稅後利潤	15,033,194	21,126,121
調整	-	65,966
基金單位持有人應佔資產淨值之增加	15,033,194	21,192,087

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

全面收入報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

大成中國靈活配置基金

	自二零一五年一月一日至 二零一五年六月三十日止期間	自二零一四年三月三日(開始運 作之日)至二零一四年十二月三 十一日止期間
	(未經審計) 人民幣	(經審計) 人民幣
收益		
股息收益	4,349,670	672,450
利息收益	555,085	61,217
投資淨收益	67,394,780	38,839,422
匯兌淨損失	(1,382,637)	(725,081)
其他收入	2,646	-
總投資收益	70,919,544	38,848,008
開支		
管理費用	4,302,356	606,779
應付受託人費用	541,277	211,664
託管費	635,245	181,634
初始設立費用	17,161	528,696
交易買賣費用	2,639,658	370,989
核數師酬金	84,027	142,776
其他費用	181,791	112,752
總經營支出	8,401,515	2,155,290
利潤分派前及稅前利潤	62,518,029	36,692,718
對基金單位持有人的分派利潤	(14,415,400)	(2,183,855)
利潤分派後及稅前利潤	48,102,629	34,508,863
稅項	(533,782)	(314,279)
基金單位持有人應佔資產淨值之 增加	47,568,847	34,194,584



大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	自二零一五年一月一日至 二零一五年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零一四年一月一日至二零 一四年十二月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
期初基金單位持有人應佔資產淨值	1,017,340,455	200,567,255
發行單位所得款項	921,094	915,772,656
贖回單位所得款項	(36,543,474)	(120,191,543)
來自單位元交易的增加淨額	(35,622,380)	795,581,113
基金單位持有人應佔資產淨值之增加	15,033,194	21,192,087
期末基金單位持有人應佔資產淨值	996,751,269	1,017,340,455

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	自二零一五年一月一日至 二零一五年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零一四年三月三日 (開始 運作之日) 至二零一四年十二 月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
期初基金單位持有人應佔資產淨值	273,195,875	-
發行單位所得款項	1,765,417,399	339,615,202
贖回單位所得款項	(969,183,087)	(100,613,911)
來自單位元交易的增加淨額	796,234,312	239,001,291
基金單位持有人應佔資產淨值之增加	47,568,847	34,194,584
期末基金單位持有人應佔資產淨值	1,116,999,034	273,195,875

大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市或報價債務證券			
債務證券			
中國			
11海螺01	500,000	50,775,000	5.09
15航空技CP001	500,000	50,361,250	5.05
12首旅MTN1	400,000	40,099,200	4.02
13光明MTN2	300,000	30,232,530	3.03
11唐新01	400,000	41,221,000	4.14
14国开08	300,000	30,868,410	3.10
15东航SCP001	500,000	50,199,300	5.04
14中电科MTN001	400,000	41,038,200	4.12
11铁道MTN1	100,000	10,130,790	1.02
12中色MTN1	500,000	50,488,750	5.07
11上实MTN2	200,000	20,275,260	2.03
14船重MTN001	300,000	30,556,410	3.07
13中南方MTN002	300,000	30,404,790	3.05
12电网MTN1	500,000	50,030,650	5.02
12南车集MTN1	100,000	10,018,790	1.01
14大秦CP001	300,000	30,025,980	3.01
15凤传媒SCP001	200,000	20,133,780	2.02
11穗地铁MTN1	300,000	30,508,080	3.06
14豫能源SCP002	400,000	40,016,840	4.01
14华电煤业CP002	500,000	50,152,400	5.03
13闽能源MTN1	200,000	20,093,000	2.02
08江铜债	585,570	57,602,521	5.77
13金川MTN1	100,000	10,034,000	1.01
14华侨城MTN001	200,000	20,396,860	2.05
09紫江债	80,000	8,192,008	0.82
07神华债	400,000	40,968,680	4.11
14深高速MTN001	200,000	20,346,820	2.04
13川投01	400,000	42,495,240	4.26
11华润MTN2	200,000	20,228,620	2.03

大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
（大成投資信託基金的子基金）

投資組合（未經審計）
截至二零一五年六月三十日

上市或報價債務證券總額	947,895,159	95.10
其他淨資產	<u>48,856,110</u>	<u>4.90</u>
截至二零一五年六月三十日淨資產	<u>996,751,269</u>	<u>100.00</u>
以成本計量的總資產	<u><u>933,976,027</u></u>	



大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十 二月三十一日	添置	出售	二零一五年 六月三十日
上市或報價債務證券				
11 海螺 01	500,000	500,000	(500,000)	500,000
11 唐新 01	400,000	-	-	400,000
12 大秦債	204,400	-	(204,400)	-
11 閩高速	50,000	-	(50,000)	-
11 東磁債	50,000	-	(50,000)	-
08 江銅債	560,000	25,570	-	585,570
09 紫江債	80,000	-	-	80,000
13 川投 01	400,000	400,000	(400,000)	400,000
12 國控 01	161,690	-	(161,690)	-
12 萬向債	100,000	-	(100,000)	-
12 中興 01	100,546	-	(100,546)	-
非上市債務證券				
14 中鋁 CP002	200,000	-	(200,000)	-
14 中鋁 CP001	300,000	-	(300,000)	-
15 航空技 CP001	-	500,000	-	500,000
12 首旅 MTN1	400,000	-	-	400,000
13 光明 MTN2	300,000	300,000	(300,000)	300,000
14 核風電 CP001	300,000	-	(300,000)	-
14 國開 08	300,000	-	-	300,000
15 東航 SCP001	-	500,000	-	500,000
14 中電科 MTN001	400,000	400,000	(400,000)	400,000
11 鐵道 MTN1	100,000	100,000	(100,000)	100,000
14 中鋁 CP001	300,000	-	(300,000)	-
12 中色 MTN1	500,000	-	-	500,000
11 華潤 MTN2	200,000	200,000	(200,000)	200,000
14 船重 MTN001	300,000	300,000	(300,000)	300,000
13 中南方 MTN002	300,000	-	-	300,000
12 電網 MTN1	500,000	-	-	500,000
12 南車集 MTN1	100,000	-	-	100,000
14 大秦 CP001	-	300,000	-	300,000
13 閩能源 MTN1	200,000	200,000	(200,000)	200,000
11 穗地鐵 MTN1	300,000	-	-	300,000
14 穗地鐵 CP001	200,000	-	(200,000)	-

大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十 二月三十一日	添置	出售	二零一五年 六月三十日
非上市債務證券(續)				
14 豫能源 SCP002	-	400,000	-	400,000
14 华电煤业 CP002	-	500,000	-	500,000
15 凤传媒 SCP001	-	200,000	-	200,000
13 金川 MTN1	100,000	100,000	(100,000)	100,000
13 泸州窖 MTN1	200,000	-	(200,000)	-
14 华侨城 MTN001	200,000	-	-	200,000
14 陕煤化 CP001	300,000	-	(300,000)	-
07 神华债	400,000	-	-	400,000
14 深机场 CP001	100,000	-	(100,000)	-
14 深高速 MTN001	200,000	200,000	(200,000)	200,000
14 深投控 CP001	200,000	-	(200,000)	-
11 上实 MTN2	200,000	-	-	200,000
10 国联 MTN1	100,000	-	(100,000)	-



大成投資信託基金
大成中國人民幣固定收益基金
(大成投資信託基金的子基金)

表現記錄 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日
資產淨值

	子基金的淨資產值	
	RMB	
	A類單位	I類單位
財務期間結束時		
二零一五年六月三十日	64,635,812	932,115,457
二零一四年十二月三十一日	92,829,552	924,510,903
	每基金單位資產淨值	
	RMB	USD
	A類單位	I類單位
財務期間結束時		
二零一五年六月三十日	10.11	10.36
二零一四年十二月三十一日	9.98	10.18

	最高每單位申購價格		最低每單位贖回價格	
	RMB	USD	RMB	USD
	A類單位	I類單位	A類單位	I類單位
財務期間結束時				
二零一五年六月三十日 (自二零一五年一月一日起)	10.20	10.46	9.99	10.15
二零一四年十二月三十一日 (自二零一四年一月一日起)	10.08	10.43	9.73	9.95

分派披露
中期分派

登記日	除淨日	支付日	單位	幣種	每單位股息
2015年3月23日	2015年3月24日	2015年4月13日	人民幣A類單位	人民幣	0.03
2015年3月23日	2015年3月24日	2015年4月13日	美元I類單位	美元	0.03
2015年6月23日	2015年6月24日	2015年7月14日	人民幣A類單位	人民幣	0.10
2015年6月23日	2015年6月24日	2015年7月14日	美元I類單位	美元	0.10

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票			
农业银行	3,494,800	12,965,708	1.16
爱尔眼科	87,042	2,807,975	0.25
航天信息	65,100	4,212,621	0.38
海螺水泥	108,800	2,333,760	0.21
凤形股份	500	18,090	0.01
国祯环保	160,500	5,278,845	0.47
皖新传媒	104,133	3,037,560	0.27
中航机电	148,050	4,123,193	0.37
中航资本	770,444	17,835,779	1.60
中国银行	2,257,800	11,040,642	0.99
交通银行	2,446,000	20,155,040	1.80
南京银行	1,536,310	35,027,868	3.14
宝钢股份	486,800	4,254,632	0.38
金隅股份	59,200	707,440	0.06
首开股份	289,500	5,584,455	0.50
大北农	20,257	273,875	0.02
嘉寓股份	90,050	986,948	0.09
京能电力	204,500	1,826,185	0.16
北新建材	90,800	1,687,064	0.15
碧水源	192,600	9,396,954	0.84
石基信息	35,124	4,565,769	0.41
四方股份	146,200	4,459,100	0.40
超图软件	14,400	528,192	0.05
华胜天成	63,500	3,037,840	0.27
北京城建	250,400	5,531,336	0.50
王府井	113,500	3,575,250	0.32
燕京啤酒	112,900	1,174,160	0.11
蓝色光标	630,076	9,961,502	0.89
汤臣倍健	145,877	5,730,049	0.51
长春燃气	139,800	1,673,406	0.15
博瑞传播	202,200	3,140,166	0.28
航天电子	72,300	1,771,350	0.16
中国宝安	49,940	814,521	0.07

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
中信銀行	3,262,600	25,154,646	2.25
中國船舶	372,721	19,195,132	1.72
華夏幸福	338,300	10,301,235	0.92
中國人壽	229,100	7,175,412	0.64
招商銀行	692,364	12,961,054	1.16
招商地產	230,000	7,277,200	0.65
五礦稀土	109,900	2,811,242	0.25
民生銀行	1,300,000	12,922,000	1.16
中國核電	19,000	248,330	0.02
中國太保	81,613	2,463,080	0.22
中國石化	2,049,900	14,472,294	1.30
中國鐵建	579,300	9,054,459	0.81
中國中鐵	931,400	12,750,866	1.14
中海集運	547,400	5,200,300	0.47
南方航空	469,400	6,825,076	0.61
中國建築	1,278,100	10,621,011	0.95
中國聯通	536,100	3,929,613	0.35
萬科A	999,500	14,512,740	1.30
中文傳媒	141,500	3,390,340	0.30
藍黛傳動	500	11,905	0.01
維鷹农牧	288,900	5,546,880	0.50
信达地產	530,700	4,372,968	0.39
中信國安	123,100	2,901,467	0.26
中信重工	190,900	3,111,670	0.28
中信證券	99,600	2,680,236	0.24
中糧地產	425,500	8,037,695	0.72
東華軟件	53,500	1,538,125	0.14
東方電氣	479,200	9,809,224	0.88
東方財富	42,000	2,649,780	0.24
恒鋒工具	500	10,055	0.01
金融街	375,300	5,302,989	0.47
福耀玻璃	595,900	8,509,452	0.76

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
金地集團	1,028,200	13,006,730	1.16
歌爾聲學	114,200	4,099,780	0.37
長城汽車	126,000	5,387,760	0.48
格力電器	136,600	8,728,740	0.78
奧飛動漫	100,800	3,815,280	0.34
粵傳媒	239,600	3,522,120	0.32
海印股份	137,600	2,957,024	0.26
廣匯能源	287,400	2,988,960	0.27
柳工	324,000	3,829,680	0.34
廣日股份	178,300	3,558,868	0.32
國泰君安	7,000	240,380	0.02
海寧皮城	200,000	3,926,000	0.35
巨星科技	212,800	3,932,544	0.35
先鋒電子	500	21,730	0.01
雙匯發展	160,500	3,423,465	0.31
宏發股份	129,600	4,061,664	0.36
華發股份	293,258	5,307,970	0.48
華蘭生物	51,700	2,289,793	0.20
華夏銀行	241,700	3,676,257	0.33
湖北能源	375,400	3,273,488	0.29
福星股份	197,500	2,786,725	0.25
江南紅箭	60,300	1,571,418	0.14
工商銀行	629,000	3,321,120	0.30
興業銀行	709,000	12,230,250	1.09
興業證券	256,200	3,507,378	0.31
內蒙華電	729,400	5,966,492	0.53
億利能源	126,807	1,853,918	0.17
金誠信	1,000	24,750	0.01
江西銅業	53,700	1,155,087	0.10
際華集團	123,900	1,873,368	0.17
冀中能源	457,620	3,670,112	0.33
聚龍股份	62,100	2,508,840	0.22

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
康美药业	107,000	1,897,110	0.17
乐普医疗	63,900	2,592,423	0.23
鲁 泰 A	307,700	4,277,030	0.38
鲁信创投	313,422	11,747,057	1.05
美都能源	391,000	4,160,240	0.37
美的集团	157,000	5,852,960	0.52
新华保险	50,000	3,053,000	0.27
新 希 望	179,400	3,482,154	0.31
宁波华翔	8	166	0.01
宁波港	1,116,200	9,867,208	0.88
出版传媒	263,063	3,740,756	0.33
海油工程	150,000	2,499,000	0.22
东华能源	60,200	1,795,766	0.16
庞大集团	1,413,622	7,718,376	0.69
攀钢钒钛	635,800	3,407,888	0.31
平安银行	750,900	10,918,086	0.98
中国平安	172,300	14,118,262	1.26
保利地产	1,165,900	13,314,578	1.19
濮阳惠成	500	6,575	0.01
青岛海尔	413,600	12,544,488	1.12
上汽集团	278,200	6,287,320	0.56
三安光电	296,900	9,292,970	0.83
国海证券	850,300	14,285,040	1.28
陕国投 A	37,300	524,811	0.05
晨鸣纸业	212,700	1,907,919	0.17
航天机电	88,300	1,415,449	0.13
百联股份	67,600	1,406,756	0.13
康耐特	51,456	748,685	0.07
复星医药	26,700	772,698	0.07
锦江股份	124,500	3,710,100	0.33
兰生股份	106,000	4,094,780	0.37
上海机电	119,500	3,936,330	0.35
上海医药	32,100	714,867	0.06

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
巴安水务	149,800	2,771,300	0.25
外高桥	191,600	6,721,328	0.60
振华重工	100	1,050	0.01
西山煤电	382,676	3,627,768	0.32
生益科技	470,000	4,789,300	0.43
申万宏源	1,018,200	16,545,750	1.48
农产品	341,400	6,964,560	0.62
海普瑞	70,400	2,392,896	0.21
深科技	229,500	3,499,875	0.31
四川长虹	1,155,100	11,366,184	1.02
西部资源	90	1,991	0.01
思源电气	235,100	4,325,840	0.39
国金证券	77,000	1,878,800	0.17
上海石化	260,443	2,794,553	0.25
金螳螂	107,000	3,016,330	0.27
冀东水泥	41,000	539,150	0.05
特变电工	73,100	1,082,611	0.10
天地科技	127,700	2,182,393	0.20
津滨发展	376,600	3,592,764	0.32
时代出版	129,800	2,817,958	0.25
环旭电子	438,700	7,462,287	0.67
威创股份	36,300	1,125,300	0.10
华数传媒	90,600	3,241,668	0.29
西部矿业	455,300	4,971,876	0.45
五粮液	44,000	1,394,800	0.12
徐工机械	857,600	11,380,352	1.01
法拉电子	104,300	3,228,085	0.29
厦门国贸	382,100	4,294,804	0.38



大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
张 裕 A	191,393	9,338,064	0.84
易联众	80,000	3,164,000	0.28
永辉超市	300,000	3,477,000	0.31
用友网络	60,000	2,752,800	0.25
驰宏锌锗	103,100	1,504,229	0.13
片仔癀	69,075	4,605,230	0.41
獐子岛	7	138	0.01
华策影视	126,526	3,416,202	0.31
浙江医药	40,800	541,824	0.05
中金黄金	249,800	3,214,926	0.29
中兴通讯	213,300	5,078,673	0.45
報價債務證券			
中國上市			
航信转债	1,110	161,294	0.01
11徐工01	60,000	6,138,852	0.55
12大秦债	50,000	5,039,835	0.45
08江铜债	150,000	14,755,500	1.32
集體投資計劃			
深成指A	5,200,000	4,180,800	0.37
申万深成	822,578	704,456	0.06
华宝添益	702,034	70,201,294	6.28
上市或報價投資		970,160,979	86.85
其他淨資產		146,838,055	13.15
截至二零一五年六月三十日淨資產總額		1,116,999,034	100.00
以成本計量的總資產		955,163,676	

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十 二月三十一日	增加	公司行动	減少	二零一五年六月 三十日
股票					
农业银行	787,000	2,707,800	-	-	3,494,800
爱尔眼科	-	67,001	20,041	-	87,042
中国国航	-	536,400	-	(536,400)	-
航天信息	-	65,100	-	-	65,100
鞍钢股份	-	177,300	-	(177,300)	-
海螺水泥	85,300	282,300	-	(258,800)	108,800
凤形股份	-	500	-	-	500
国祯环保	-	53,500	107,000	-	160,500
安徽合力	-	89,600	-	(89,600)	-
江淮汽车	-	103,200	-	(103,200)	-
皖能电力	76,900	5,400	-	(82,300)	-
皖新传媒	-	104,133	-	-	104,133
安信信托	26,907	-	-	(26,907)	-
中航机电	-	135,000	13,050	-	148,050
中航资本	-	770,444	-	-	770,444
北京银行	-	1,042,100	-	(1,042,100)	-
中国银行	-	2,257,800	-	-	2,257,800
交通银行	-	2,446,000	-	-	2,446,000
南京银行	275,100	1,261,210	-	-	1,536,310
宝钛股份	-	64,800	-	(64,800)	-
宝钢股份	-	671,700	-	(184,900)	486,800
金隅股份	-	59,200	-	-	59,200
首创股份	-	107,000	-	(107,000)	-
首开股份	-	289,500	-	-	289,500
康拓红外	-	500	-	(500)	-
大北农	-	109,000	3,752	(92,495)	20,257
数字政通	-	59,700	-	(59,700)	-
嘉寓股份	84,150	5,900	-	-	90,050
京能电力	-	204,500	-	-	204,500
北新建材	42,400	3,000	45,400	-	90,800
碧水源	-	192,600	-	-	192,600
三聚环保	15,200	1,100	-	(16,300)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票 (續)					
雪迪龙	13,300	54,400	81,240	(148,940)	-
石基信息	-	68,124	-	(33,000)	35,124
四方股份	-	146,200	-	-	146,200
双杰电气	-	500	-	(500)	-
超图软件	-	62,500	5,400	(53,500)	14,400
华胜天成	-	63,500	-	-	63,500
北京城建	100,000	250,400	-	(100,000)	250,400
王府井	-	155,200	-	(41,700)	113,500
燕京啤酒	-	629,200	-	(516,300)	112,900
福田汽车	175,800	706,200	-	(882,000)	-
号百国脉	-	61,700	-	(61,700)	-
蓝色光标	-	315,401	314,775	(100)	630,076
京东方	-	315,300	-	(315,300)	-
渤海租赁	-	56,600	-	(56,600)	-
汤臣倍健	-	145,877	-	-	145,877
长春燃气	-	139,800	-	-	139,800
长江传媒	-	102,900	-	(102,900)	-
博瑞传播	-	202,200	-	-	202,200
航天电子	-	72,300	-	-	72,300
中国宝安	-	49,940	-	-	49,940
中信银行	-	3,262,600	-	-	3,262,600
中国船舶	-	372,721	-	-	372,721
中青旅	-	47,967	-	(47,967)	-
中华企业	-	174,700	-	(174,700)	-
华夏幸福	117,500	103,300	117,500	-	338,300
海南橡胶	-	30,500	-	(30,500)	-
中科英华	-	172,300	-	(172,300)	-
中国人寿	166,600	229,100	-	(166,600)	229,100
中国医药	-	79,900	-	(79,900)	-
招商银行	475,164	217,200	-	-	692,364
招商地产	130,000	100,000	-	-	230,000
五矿稀土	38,600	112,600	-	(41,300)	109,900

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年 十二月三十 一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
民生银行	790,300	950,000	-	(440,300)	1,300,000
中国化学	-	81,100	-	(81,100)	-
中国核电	-	19,000	-	-	19,000
北方稀土	-	111,600	27,000	(138,600)	-
中国太保	-	323,413	-	(241,800)	81,613
中国石化	571,000	1,667,600	-	(188,700)	2,049,900
中国铁建	300,000	279,300	-	-	579,300
中国中铁	-	941,700	-	(10,300)	931,400
中国重工	-	87,400	-	(87,400)	-
中海集运	-	547,400	-	-	547,400
中海發展	-	48,400	-	(48,400)	-
南方航空	-	469,400	-	-	469,400
中国建筑	350,200	927,900	-	-	1,278,100
中国联通	501,000	167,100	-	(132,000)	536,100
万科	451,700	547,800	-	-	999,500
中文传媒	-	141,500	-	-	141,500
长安汽车	77,500	5,400	-	(82,900)	-
重庆百货	-	49,200	-	(49,200)	-
涪陵榨菜	30,000	-	-	(30,000)	-
蓝黛传动	-	500	-	-	500
重庆水务	-	321,000	-	(321,000)	-
雏鹰农牧	-	288,900	-	-	288,900
信达地产	-	530,700	-	-	530,700
中信国安	-	123,100	-	-	123,100
中信重工	190,900	-	-	-	190,900
中信证券	99,600	-	-	-	99,600
中国重汽	101,800	7,100	-	(108,900)	-
中粮地产	-	425,500	-	-	425,500
中粮屯河	101,000	7,100	-	(108,100)	-
华映科技	-	118,000	-	(118,000)	-
南玻	100,000	7,000	-	(107,000)	-
大连重工	49,600	3,500	-	(53,100)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
大秦铁路	200,000	14,000	-	(214,000)	-
大商股份	20,000	24,800	-	(44,800)	-
东华软件	-	53,500	-	-	53,500
东方电气	97,700	435,100	-	(53,600)	479,200
搜于特	-	74,600	-	(74,600)	-
东方财富	-	30,000	12,000	-	42,000
德豪润达	-	104,300	-	(104,300)	-
恒锋工具	-	500	-	-	500
一汽轿车	157,600	11,000	-	(168,600)	-
飞乐音响	128,300	9,000	-	(137,300)	-
金融街	275,300	100,000	-	-	375,300
方正证券	-	98,100	-	(98,100)	-
龙净环保	60,000	4,200	-	(64,200)	-
圣农发展	-	107,000	-	(107,000)	-
福耀玻璃	100,000	495,900	-	-	595,900
亚盛集团	-	148,800	-	(148,800)	-
杰赛科技	100,032	7,000	-	(107,032)	-
国电电力	567,900	755,000	-	(1,322,900)	-
金地集团	-	1,028,200	-	-	1,028,200
歌尔声学	-	114,200	-	-	114,200
长城汽车	150,000	26,000	-	(50,000)	126,000
格力电器	151,800	47,200	-	(62,400)	136,600
奥飞动漫	-	82,500	50,400	(32,100)	100,800
依顿电子	-	60,600	-	(60,600)	-
粤传媒	-	239,600	-	-	239,600
海印股份	-	137,600	-	-	137,600
塔牌集团	200,500	14,000	-	(214,500)	-
万和电气	-	128,400	-	(128,400)	-
新宝股份	-	81,900	-	(81,900)	-
广汇能源	-	287,400	-	-	287,400
广深铁路	-	87,500	-	(87,500)	-
柳工	-	431,100	-	(107,100)	324,000

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
中恒集團	67,700	4,700	-	(72,400)	-
廣日股份	-	178,300	-	-	178,300
廣船國際	-	24,700	-	(24,700)	-
貴人鳥	-	26,300	-	(26,300)	-
天成控股	-	77,800	-	(77,800)	-
國泰君安	-	7,000	-	-	7,000
海馬汽車	-	196,000	-	(196,000)	-
海峽股份	-	96,500	-	(96,500)	-
海寧皮城	-	200,000	-	-	200,000
海通證券	-	307,200	-	(307,200)	-
巨星科技	-	212,800	-	-	212,800
濱江集團	169,300	-	-	(169,300)	-
杭氧股份	122,900	8,600	-	(131,500)	-
海康威視	41,300	2,900	-	(44,200)	-
先鋒電子	-	500	-	-	500
老板電器	-	32,100	-	(32,100)	-
中恒電氣	-	30,000	-	(30,000)	-
快樂購	-	60,000	-	(60,000)	-
譽衡藥業	22,500	1,600	-	(24,100)	-
哈藥股份	-	140,800	-	(140,800)	-
建新股份	41,400	2,900	-	(44,300)	-
海瀾之家	-	32,300	-	(32,300)	-
瑞貝卡	-	216,400	-	(216,400)	-
雙匯發展	-	107,000	53,500	-	160,500
亨通光電	-	71,084	-	(71,084)	-
海信電器	-	296,900	-	(296,900)	-
海信科龍	-	138,285	-	(138,285)	-
同花順	-	66,400	-	(66,400)	-
宏發股份	-	129,600	-	-	129,600
華發股份	55,000	293,258	-	(55,000)	293,258
華蘭生物	-	81,800	-	(30,100)	51,700
華夏銀行	241,700	-	-	-	241,700

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票 (續)					
湖北能源	-	375,400	-	-	375,400
福星股份	-	197,500	-	-	197,500
江南紅箭	-	60,300	-	-	60,300
恒生電子	-	126,937	-	(126,937)	-
工商銀行	629,000	-	-	-	629,000
興業銀行	296,900	712,100	-	(300,000)	709,000
興業證券	106,200	150,000	-	-	256,200
內蒙華電	-	729,400	-	-	729,400
億利能源	-	230,107	-	(103,300)	126,807
江河創建	-	120,600	-	(120,600)	-
金誠信	-	1,000	-	-	1,000
江蘇有線	-	2,000	-	(2,000)	-
澄星股份	-	159,000	-	(159,000)	-
恩華藥業	-	53,500	10,700	(64,200)	-
鳳凰傳媒	-	90,000	-	(90,000)	-
揚農化工	100,000	71,200	-	(171,200)	-
中天科技	44,300	3,100	-	(47,400)	-
江西銅業	-	194,100	-	(140,400)	53,700
洪都航空	-	35,900	-	(35,900)	-
三鑫醫療	-	500	-	(500)	-
際華集團	-	123,900	-	-	123,900
吉林敖東	37,900	2,700	-	(40,600)	-
紫鑫藥業	-	79,900	-	(79,900)	-
金科股份	66,900	-	133,800	(200,700)	-
吉視傳媒	-	104,800	-	(104,800)	-
冀中能源	-	476,000	76,320	(94,700)	457,620
九陽股份	-	214,000	-	(214,000)	-
巨力索具	-	113,800	-	(113,800)	-
聚龍股份	-	62,100	-	-	62,100
凱瑞德	-	80,000	-	(80,000)	-
康美藥業	50,000	3,500	53,500	-	107,000
貴州茅台	16,000	10,800	-	(26,800)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
乐普医疗	-	63,900	-	-	63,900
乐视网	-	53,500	-	(53,500)	-
福鞍股份	-	1,000	-	(1,000)	-
罗牛山	-	164,500	-	(164,500)	-
鲁泰	69,700	312,600	-	(74,600)	307,700
鲁信创投	-	334,322	-	(20,900)	313,422
美都能源	-	589,500	-	(198,500)	391,000
软控股份	-	100,000	-	(100,000)	-
中国中冶	-	664,000	-	(664,000)	-
京投银泰	103,200	-	-	(103,200)	-
美的集团	-	157,000	-	-	157,000
五矿发展	-	103,900	-	(103,900)	-
牧原股份	12,110	800	-	(12,910)	-
东软集团	-	74,500	-	(74,500)	-
新华保险	50,000	-	-	-	50,000
新希望	79,100	100,300	-	-	179,400
宁波华翔	38,400	2,700	-	(41,092)	8
宁波港	-	1,116,200	-	-	1,116,200
出版传媒	-	263,063	-	-	263,063
海油工程	140,200	9,800	-	-	150,000
东方证券	-	6,000	-	(6,000)	-
东华能源	56,300	3,900	-	-	60,200
掌趣科技	-	80,000	-	(80,000)	-
庞大集团	112,500	1,334,361	591,161	(624,400)	1,413,622
攀钢钒钛	-	635,800	-	-	635,800
平安银行	300,000	360,900	90,000	-	750,900
中国平安	80,000	92,300	-	-	172,300
平煤股份	-	221,700	-	(221,700)	-
保利地产	380,500	785,400	-	-	1,165,900
濮阳惠成	-	500	-	-	500
青岛海尔	188,000	476,800	-	(251,200)	413,600
日照港	-	196,101	-	(196,101)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票 (續)					
上汽集團	180,500	97,700	-	-	278,200
三安光电	-	296,900	-	-	296,900
国投电力	100,000	7,000	-	(107,000)	-
国海证券	-	850,300	-	-	850,300
海虹控股	-	66,500	-	(66,500)	-
陕国投A	-	98,700	-	(61,400)	37,300
晨鸣纸业	141,300	222,600	-	(151,200)	212,700
豪迈科技	-	68,600	-	(68,600)	-
好当家	-	177,400	-	(177,400)	-
金晶科技	-	216,600	-	(216,600)	-
太阳纸业	178,500	12,500	-	(191,000)	-
新北洋	57,300	4,000	-	(61,300)	-
三爱富	-	83,300	-	(83,300)	-
航天机电	-	88,300	-	-	88,300
爱建股份	-	68,200	-	(68,200)	-
百联股份	-	67,600	-	-	67,600
百润股份	15,600	32,100	-	(47,700)	-
创力集团	-	1,000	-	(1,000)	-
康耐特	32,160	-	19,296	-	51,456
上海能源	69,800	154,900	-	(224,700)	-
大众公用	-	114,900	57,450	(172,350)	-
复星医药	25,000	1,700	-	-	26,700
上海机场	50,000	3,500	-	(53,500)	-
锦江股份	-	124,500	-	-	124,500
卫宁软件	-	14,100	-	(14,100)	-
兰生股份	-	106,000	-	-	106,000
上海机电	41,000	122,400	-	(43,900)	119,500
美邦服饰	-	107,000	-	(107,000)	-
上海医药	30,000	2,100	-	-	32,100
浦发银行	-	795,800	-	(795,800)	-
巴安水务	-	107,000	42,800	-	149,800
世茂股份	-	130,800	-	(130,800)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
外高桥	-	191,600	-	-	191,600
新华传媒	-	101,580	-	(101,580)	-
振华重工	-	141,100	-	(141,000)	100
西山煤电	-	382,676	-	-	382,676
申能股份	-	468,050	-	(468,050)	-
生益科技	67,500	630,100	-	(227,600)	470,000
申万宏源	-	1,018,200	-	-	1,018,200
农产品	-	341,400	-	-	341,400
深高速	150,000	10,500	-	(160,500)	-
海普瑞	-	100,700	-	(30,300)	70,400
深科技	-	454,500	-	(225,000)	229,500
世联行	-	66,400	-	(66,400)	-
顺发恒业	132,800	-	-	(132,800)	-
四川长虹	-	1,296,500	-	(141,400)	1,155,100
四川路桥	-	161,800	-	(161,800)	-
西部资源	19,800	1,400	-	(21,110)	90
思源电气	-	235,100	-	-	235,100
国金证券	77,000	-	-	-	77,000
中材国际	-	53,200	-	(53,200)	-
上海石化	-	535,243	-	(274,800)	260,443
宋城演艺	-	16,900	-	(16,900)	-
太阳鸟	-	300,000	-	(300,000)	-
苏宁云商	-	86,100	-	(86,100)	-
香溢融通	-	93,000	-	(93,000)	-
阳光城	76,100	-	-	(76,100)	-
东山精密	-	89,300	-	(89,300)	-
金螳螂	-	107,000	-	-	107,000
苏州高新	-	174,967	-	(174,967)	-
冀东水泥	-	41,000	-	-	41,000
特变电工	-	73,100	-	-	73,100
泰禾集团	56,800	-	-	(56,800)	-
天地科技	24,300	236,400	-	(133,000)	127,700



大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票 (續)					
津滨发展	-	513,900	-	(137,300)	376,600
天药股份	-	172,163	-	(172,163)	-
时代出版	-	129,800	-	-	129,800
通化东宝	-	115,600	11,560	(127,160)	-
同方股份	-	170,500	-	(170,500)	-
环旭电子	-	251,200	187,500	-	438,700
华帝股份	-	107,000	-	(107,000)	-
威创股份	-	235,300	-	(199,000)	36,300
网宿科技	2,599	-	-	(2,599)	-
万华化学	75,100	5,300	-	(80,400)	-
华数传媒	-	90,600	-	-	90,600
西部矿业	-	455,300	-	-	455,300
五粮液	72,500	263,100	-	(291,600)	44,000
徐工机械	85,600	948,800	-	(176,800)	857,600
建发股份	100,000	7,000	-	(107,000)	-
法拉电子	-	104,300	-	-	104,300
厦门国贸	-	382,100	-	-	382,100
北新路桥	-	107,000	-	(107,000)	-
天富能源	-	117,800	-	(117,800)	-
天山股份	-	110,800	-	(110,800)	-
新疆城建	-	214,000	-	(214,000)	-
雪峰科技	-	1,000	-	(1,000)	-
亚宝药业	-	124,500	-	(124,500)	-
张裕	-	271,393	-	(80,000)	191,393
远光软件	-	24,200	-	(24,200)	-
易联众	-	80,000	-	-	80,000
永辉超市	-	300,000	-	-	300,000
用友网络	-	50,000	10,000	-	60,000
雅戈尔	156,400	33,500	-	(189,900)	-
驰宏锌锗	-	103,100	-	-	103,100
锡业股份	-	154,400	-	(154,400)	-
片仔廣	-	32,070	37,005	-	69,075

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六月 三十日
股票(續)					
獐子島	-	60,107	-	(60,100)	7
爱仕达	86,600	-	-	(86,600)	-
古越龙山	-	78,500	-	(78,500)	-
华策影视	-	126,526	-	-	126,526
巨化股份	-	169,700	-	(169,700)	-
浙江龙盛	50,000	3,500	-	(53,500)	-
浙江医药	74,200	219,300	-	(252,700)	40,800
新和成	-	169,600	-	(169,600)	-
森马服饰	-	30,000	30,000	(60,000)	-
苏泊尔	-	415,400	-	(415,400)	-
尤夫股份	71,390	5,000	-	(76,390)	-
万安科技	64,680	-	-	(64,680)	-
友邦吊顶	10,200	700	-	(10,900)	-
浙能电力	-	320,500	-	(320,500)	-
郑煤机	-	147,000	-	(147,000)	-
宇通客车	80,000	5,600	-	(85,600)	-
中弘股份	234,500	-	-	(234,500)	-
中金黄金	-	249,800	-	-	249,800
紫金矿业	-	535,000	-	(535,000)	-
中联重科	-	193,761	-	(193,761)	-
中兴通讯	-	213,300	-	-	213,300



大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)
自二零一五年一月一日至二零一五年六月三十日止期間

	二零一四年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一五年六 月三十日
債務證券					
航信转债	-	1,110	-	-	1,110
12大秦债	-	80,000	-	(30,000)	50,000
08 江铜债	86,630	322,880	-	(259,510)	150,000
13 日照港	-	50,000	-	(50,000)	-
11 上港 02	5,000	-	-	(5,000)	-
11 徐工 01	-	60,000	-	-	60,000
12中兴01	-	30,000	-	(30,000)	-
集體投資計劃					
华宝添益	21,204	2,614,526	-	(1,933,696)	702,034
申万深成	-	-	822,578	-	822,578
深成指A	5,200,000	-	-	-	5,200,000
银华日利	76,800	520,000	-	(596,800)	-
期貨					
CSI300 指數期貨2015年1月	(31)	33	-	(2)	-
CSI300 指數期貨2015年6月	(1)	20	-	(19)	-
CSI300 指數期貨2015年3月	(16)	23	-	(7)	-
CSI300 指數期貨2015年9月	-	90	-	(90)	-

大成投資信託基金
大成中國靈活配置基金
(大成投資信託基金的子基金)

表現記錄 (未經審計)
截至二零一五年六月三十日
資產淨值

財務期	子基金的淨資產值		
	人民幣 A類單位		
二零一五年六月三十日	1,116,999,034		
二零一四年十二月三十一日	273,195,875		
財務期間結束時	每基金單位資產淨值		
	人民幣A類單位	美元A類單位	港幣A類單位
二零一五年六月三十日	15.39	15.17	15.15
二零一四年十二月三十一日	13.17	12.94	12.93

財務期間結束時	最高每單位申購價格			最低每單位贖回價格		
	RMB A類單位	USD A類單位	HKD A類單位	RMB A類單位	USD A類單位	HKD A類單位
二零一五年六月三十日 (自二零一五年一月一日起)	17.90	17.62	17.60	12.73	12.47	12.45
二零一四年十二月三十一日 (自二零一四年三月三日起 (开始运作之日))	13.17	12.94	12.93	9.50	9.30	9.29

分派披露
中期分派

登記日	除淨日	支付日	單位	幣種	每單位股息
2015年3月23日	2015年3月24日	2015年4月13日	人民幣A類單位	人民幣	0.10
2015年3月23日	2015年3月24日	2015年4月13日	美元A類單位	美元	0.10
2015年3月23日	2015年3月24日	2015年4月13日	港幣A類單位	港幣	0.10
2015年6月23日	2015年6月24日	2015年7月14日	人民幣A類單位	人民幣	0.15
2015年6月23日	2015年6月24日	2015年7月14日	美元A類單位	美元	0.15
2015年6月23日	2015年6月24日	2015年7月14日	港幣A類單位	港幣	0.15