

大成财富管理2020生命周期证券投资基金

[2012]第三季度报告

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:2012年10月25日重要提示
基金管理人和基金托管人根据法律法规规定,于2012年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、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2012年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人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。

本报吿期自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:大成财富管理2020生命周期混合基金

交易代码:090006

前端交易代码:090006

后端交易代码:091006

基金合同生效日:2006年9月13日

报告期末基金份额总额:12,258,335,169.35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,货币市场工具,通过资产配置实现资产的长期增值,超越业绩比较基准,寻求一定的风险承受水平,在2020年12月31日以前,本基金侧重于当期收益,资本增殖为辅。

在2020年12月31日之后,本基金侧重于当期收益,资本增殖为辅。

本基金在综合构建中强调风险收益比的合理化,将纪律性与科学性结合在一起,建立较全的资产、券种投资评价体系,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,即在股票、债券、货币市场工具之间的配置比例;第二个层次是股票证券和固定收益类证券等的投资策略。

本基金的同生效日起至2010年12月31日,75%×新华富时中国A600指数+25%×中信债券指数。

2011年1月1日至2015年12月31日,45%×沪深300指数+55%×中国国债总指数。

2016年1月1日至2020年12月31日,25%×沪深300指数+75%×中国国债总指数。

2021年1月1日以及以后:10%×沪深300指数+90%×货币市场基金。

本基金属于生命周期基金,2020年12月31日以后,本基金的风险与收益将随着时点的逐步降低,即本基金初投资阶段的风险收益水平将接近股票基金,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

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -114,463,365.65

2.本期利润 -318,807,281.95

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0258

4.期末基金资产净值 7,507,183,116.58

5.期末基金份额净值 0.612

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。

5.期末基金份额净值 7,507,183,116.58

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金利润指收入扣除所有交易费用,以计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

4.期末基金份额净值增长率为本期基金份额净值增长与期末基金份额净值的比值。