

信息披露 Disclosure

大成优选股票型证券投资基金(LOF)

[2015] 第一季度报告

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:2015年4月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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的规定，于2015年4月16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，确认本报告的内容真实、准确、完整。

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。投资人选择本基金，投资人须仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大成优选(LOF)

场内简称 优选LOF

交易代码 160016

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2012年7月2日

报告期末基金份额总额 747,451,626份

报告日期 在有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳健增长。

本基金将充分重视基本面，基于对宏观经济的研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，采用优秀的主动投资策略，获取超额收益。优先个股投资策略，即在全面了解公司基本面的基础上，选择具有上市公司的基本面，总体公司价值，当股价位于合理估值区间时买入并持有，获得超额回报的股票进行投资，分股投资并持有超长的投资期限。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×10%+国债收益率×90%

风险收益特征 本基金属于股票型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币基金、债券基金与货币市场基金，属高风险收益特征的开放式基金。

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

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 146,716,603.19

2.期初现金 469,406,764.79

3.报告期平均基金份额利润 0.0367

4.期末现金及现金等价物余额 1,496,406,737.31

5.期末基金份额净值 2.001

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，计费方法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(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去三个月 38.00% 1.45% 11.94% 1.46% 26.00% -0.01%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示:基金成立以来净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

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间 证券从业年限 说明

潘义华 基金经理助理 2012年11月26日 - 9年 中国科学院管理学博士，曾就职于博时基金管理有限公司，历任基金工程师，股票投资部量化研究员，数据研究员，基金经理助理，股票投资部量化研究员兼数据研究员及衍生品研究员，2010年1月加入大成基金管理有限公司，历任股票投资部量化研究员兼数据研究员及衍生品研究员，2012年1月加入大成基金管理有限公司，担任大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理，2013年1月加入大成基金管理有限公司，担任大成新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年1月加入大成基金管理有限公司，担任大成新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，目前担任大成基金管理有限公司权益投资部投资总监，基金经理。

注:1.任本基金基金经理日期由本公司公告为准。

2.证券从业年限是指从行业协会、证监会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

基金管理人声明：本报告期内未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易机会的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度指导意见》，公司旗下所有投资组合严格按照该制度执行。

本公司高级管理人员、基金经理及其他投资研究人员、交易员在投资研究、交易决策、风险管理等方面实行公平交易制度，基金经理没有重大差别对待行为，没有运用基金资产进行利益输送交易且市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作符合公平交易规则。

4.3.2 相关基金的公平交易情况

4.3.3 公平交易对投资组合的影响

公司风险管理定期对公司旗下所有投资组合间向同向、反向交易等可能在正常交易时的交易行为进行分析。2015年1季度公司旗下所有投资组合间向同向交易10笔，因投资策略需求、主动型投资组合与被动型投资组合之间的股票在股票日内向反向交易，参与交易所公开竞价的同向交易较少，单只股票占总成交金额的比例共占1笔，原因为投资策略需要；投资组合间向反向交易存在同向反向交易，投资组合间相向交易日向交易所的市场成交比例、成交均较高且交易数据表明该类交易对市场产生重大不利影响，监管稽核部负责监督检查、事中检查和事后稽查、风险管理部负责对外交易情况行分析合理性，通过多部门的协作互动，保证了公平交易的可操作、可稽核、可持续。

4.3.4 异常交易行为的专项说明

公司风险管理定期对公司旗下所有投资组合间向同向、反向交易等可能在正常交易时的交易行为进行分析。2015年1季度公司旗下所有投资组合间向同向交易10笔，因投资策略需求、主动型投资组合与被动型投资组合之间的股票在股票日内向反向交易，参与交易所公开竞价的同向交易较少，单只股票占总成交金额的比例共占1笔，原因为投资策略需要；投资组合间向反向交易存在同向反向交易，投资组合间相向交易日向交易所的市场成交比例、成交均较高且交易数据表明该类交易对市场产生重大不利影响，监管稽核部负责监督检查、事中检查和事后稽查、风险管理部负责对外交易情况行分析合理性，通过多部门的协作互动，保证了公平交易的可操作、可稽核、可持续。

4.3.5 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》，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度指导意见》，公司旗下所有投资组合严格按照该制度执行。

本公司高级管理人员、基金经理及其他投资研究人员、交易员在投资研究、交易决策、风险管理等方面实行公平交易制度，基金经理没有重大差别对待行为，没有运用基金资产进行利益输送交易且市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作符合公平交易规则。

4.3.6 相关基金的公平交易情况

4.3.7 公平交易对投资组合的影响

公司风险管理定期对公司旗下所有投资组合间向同向、反向交易等可能在正常交易时的交易行为进行分析。2015年1季度公司旗下所有投资组合间向同向交易10笔，因投资策略需求、主动型投资组合与被动型投资组合之间的股票在股票日内向反向交易，参与交易所公开竞价的同向交易较少，单只股票占总成交金额的比例共占1笔，原因为投资策略需要；投资组合间向反向交易存在同向反向交易，投资组合间相向交易日向交易所的市场成交比例、成交均较高且交易数据表明该类交易对市场产生重大不利影响，监管稽核部负责监督检查、事中检查和事后稽查、风险管理部负责对外交易情况行分析合理性，通过多部门的协作互动，保证了公平交易的可操作、可稽核、可持续。

4.4 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 报告期末基金份额组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,407,428,486.61 99.22

2 中、短债 1,407,428,486.61 99.22

3 固定收益投资 - 0.00

其中:债券 - 0.00

4 货币市场基金 - 0.00

5 合计 1,407,428,486.61 100.00

注:1.本基金根据每日基金收益情况进行收益分配，为投资者每日计算当日收益并分配，每月最后一个工作日进行定期收益分配。

2.本基金从场外赎回的计算所取的运作周期，是以基金合同生效之日起日持并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 9,401,560.20

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635,714.47

6.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

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 1,407,428,486.61

2.期初现金 9,400,177.46

3.报告期平均基金份额利润 0.0329

4.期末现金及现金等价物余额 1,407,428,486.61

5.期末基金份额净值 730,635