

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日
§ 重要提示
基金管理人的董事会对本基金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。
本基金于2015年10月22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信息，保证本报告内不存在虚假记载、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财产，但不保证基金一定盈利。
基金管理人、基金托管人、代销机构未对本基金的过往业绩进行评级。

基金合同生效后6个月内未达到规定的最低规模，基金管理人不办理赎回。

本基金报告期2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况		
基金简称	大成强化收益定期开放债券	
交易代码	090908	
基金份额代码	090908	
启用赎回代码	091108	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年8月6日	
报告期末基金资产总额	1,983,731,374.70元	
投资目标	在严格控制资产风险基础上通过积极的资产配置，追求基金资产的稳定增值。	
投资策略	本基金在严格控制组合风险的前提下，基于稳健的决策，在资产配置、个券选择和交易策略上实施积极管理策略，以期在承担有限的风险的前提下获得较优的投资收益。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金定位于追求较低波动率的基金，基金持有人的投资要求，风险收益水平高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金。	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	

§ 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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
1.本期已实现收益	-229,300,071.83	
2.本期利润	-246,969,731.56	
3.加权平均基金份额利润率	-0.1242%	
4.期末基金资产净值	2,314,097,530.64	
5.期末基金份额净值	1.1671	

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。

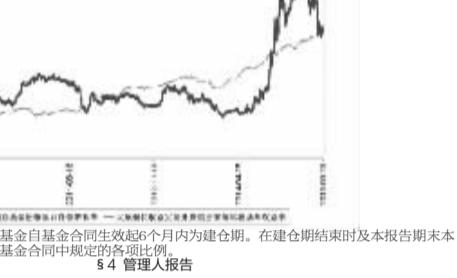
2. 所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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
业债比较基准收益率③	业债比较基准收益率标准差④	

过去一个月 -0.94% 1.20% 2.10% -0.00% -11.94% 1.14%

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，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。在建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资比例已达基金合同规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

本报告期无财务数据未经审计。

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	离任日期	离任原因
王景先	本基金基金经理	2015年6月7日	-	11年

注:1.任职日期、离任日期为本基金经理正式担任本基金基金经理之日。

2.证券从业年限是指截至本报告期末基金从业人员从事证券业工作的年限。

3.因个人健康原因辞职。

4.4 报告期内基金投资组合情况

4.4.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	201,533,386.03	99.63
2	其中:股票	201,533,386.03	99.63
3	固定收益投资	-	0.00
4	其中:债券	-	0.00
5	货币市场工具	-	0.00
6	贵金属投资	-	0.00
7	衍生金融工具	-	0.00
8	其他投资	-	0.00
9	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.2 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	20,779.94	0.01
2	其他资产	-	0.00
3	合计	204,329,762.03	100.00

4.4.3 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.4 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.5 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.6 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.7 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.8 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.9 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36
2	其他资产	-	0.00
3	合计	2,775,567.16	1.36

4.4.10 报告期内按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,775,567.16	1.36