

# 大成精选增值混合型证券投资基金

## 2015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:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月24日

基金管理人和基金份额持有人对本基金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、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约定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务数据,并发表书面意见,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺,本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并以其真实、准确、完整地反映了本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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

### § 2 基本产品概况

基金简称	大成精选增值混合
交易代码	090004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年12月15日
报告期末基金份额总额	1,099,067,401.03份

报告期投资目标与行业地位优势和长期增值能力的行业和企业,为投资者寻找持续稳定的收益。

本基金利用大成基金公开持有的投资管理资源,采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股的投资策略,主要投资于具有竞争优势和持续增长潜力的行业和企业的股票,通过精选个股,寻找持续稳定的收益。

业绩比较基准 75%×中国股票指数+25%×银行存款利率(税后)。

风险收益特征 本基金属混合型基金,由于本基金所投资的资产,主动管理的股票,使本基金的预期收益和风险均高于纯债基金,高

于行业平均,指数基金,低风险的债券基金。

基金管理人 中国农业银行股份有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

### § 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 -563,322,823.71

2.期初基金份额总额 569,385,443.76

3.报告期基金份额利润 -630.40

4.期末基金份额净值 1,129,361,344.40

5.期末基金份额净值 -1.0064

注:1.本期已实现收益为本期利息收入、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,本期利润与本期已实现收益之差即为公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人交易本基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

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(%) 净值增长(%)差值(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准差值(%)

过去三个月 -33.03% 3.44% -21.20% 251% -11.83% 0.93%

3.2.2 目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.大成基金管理有限公司根据《大成精选增值混合型证券投资基金》的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2011年1月1日起,大成精选增值混合型证券投资基金使用的业绩比较基准由原“新华富时中国A股600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%”变更为“沪深300指数×75%+中证债券指数×25%”。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
魏庆国先生	本基金基金经理	2015年4月7日	-	6年

注:1.在任职日期、任职日期均为本基金基金经理作出决定之日起。

2.证券从业年限是指从行业准入之日起至取得证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成精选增值混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成精选增值混合型证券投资基金的投资运作、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的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的情况。

本基金将继续以投资于股票,目的在于社会公众为宗旨,承诺将一如既往地严格遵守基金合同,并努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易制度的执行情况

公司对旗下所有投资组合实行公平交易制度,所有投资组合在交易行为上不存在不公平对待。

4.4 报告期内基金的绩效表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.0364元,本报告期基金份额净值增长率为-3.33%,同期业绩

比较基准收益率为-2.12%,低于同期业绩比较基准收益率-2.08%。

4.5 报告期内基金的客户服务和持有人关系管理

展望2015年4季度,我们认为中国经济将延续复苏,但经济复苏的不确定性较大,经济复苏的持续性将取决于政策的配合,将逐步企稳回升,这为中国经济的持续稳定发展注入活力,因此,继续关注互联网、互联网金融、新能源汽车等的投资机会。

4.6 报告期内基金的其他重要信息

基金管理人未有其他重要信息。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人未持有本基金的份额。

4.8 报告期内基金管理人运用固有资金投资的其他重要信息

2015年1月15日,基金管理人发布了《大成基金管理有限公司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十五次会议审议通过,独立董事不担任公司高级管理人员。

2015年1月16日,基金管理人发布了《关于公司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十五次会议审议通过,独立董事不担任公司高级管理人员。

4.9 其他需要说明的事项

本报告期基金管理人未有其他需要说明的事项。

4.10 管理人对报告期内基金运作的说明

基金管理人严格按照基金合同的约定,在分析和判断宏观经济形势的基础上,通过积极主动的

投资管理,力图在保证资产流动性的基础上,通过积极主动的

投资管理,力图在保证