

## 大成优选混合型证券投资基金(LOF)

## [2015]第四季度报告

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:2016年1月20日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董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约定，于2016年1月18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，保证复核内容不存在虚假记载、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。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12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	160916	
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27日	
报告期末基金总资产	298,189,742.05	
投资目标	在有效控制风险的基础上，追求基金资产长期稳健增值。	
本基金将全球视野，主要侧重研究、配置大类资产配置比例，通过上市公司基本面分析，精选具有核心竞争力的公司，通过深入地研究公司基本面，动态地分析公司估值，选择估值合理的优质股票，深入分析并持有，以获得长期稳定的回报。	本基金将全球视野，主要侧重研究、配置大类资产配置比例，通过上市公司基本面分析，精选具有核心竞争力的公司，通过深入地研究公司基本面，动态地分析公司估值，选择估值合理的优质股票，深入分析并持有，以获得长期稳定的回报。	
投资策略	本基金将全球视野，主要侧重研究、配置大类资产配置比例，通过上市公司基本面分析，精选具有核心竞争力的公司，通过深入地研究公司基本面，动态地分析公司估值，选择估值合理的优质股票，深入分析并持有，以获得长期稳定的回报。	本基金将全球视野，主要侧重研究、配置大类资产配置比例，通过上市公司基本面分析，精选具有核心竞争力的公司，通过深入地研究公司基本面，动态地分析公司估值，选择估值合理的优质股票，深入分析并持有，以获得长期稳定的回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×90%+中国国债指数收益率×20%	沪深300指数收益率×90%+中国国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属股票型基金，其预期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，低于股票基金。	本基金属股票型基金，其预期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，低于股票基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司	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	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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期初所有者权益	-1,036,436,651
2.本期期间损益	137,349,101.36
3.2015年期间基金利润	4,4464
4.期末所有者权益	698,539,299.41
5.期末所有者权益占净值比例	2.39%

注:1.本期实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

3.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

4.期末所有者权益指基金资产净值。

5.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:2.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

4.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

5.期末所有者权益指基金资产净值。

注:3.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

4.期末所有者权益指基金资产净值。

5.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:4.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

6.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

7.期末所有者权益指基金资产净值。

8.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:5.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

6.期末所有者权益指基金资产净值。

7.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:6.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

7.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

8.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

9.期末所有者权益指基金资产净值。

注:7.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

8.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

9.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

10.期末所有者权益指基金资产净值。

11.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:8.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

9.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

10.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

11.期末所有者权益指基金资产净值。

12.期末所有者权益占净值比例指期末所有者权益除以期末基金资产净值。

注:9.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

10.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

11.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

12.期末所有者权益指基金资产净值。

注:10.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

11.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

12.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

13.期末所有者权益指基金资产净值。

注:11.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

12.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

13.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

14.期末所有者权益指基金资产净值。

注:12.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

13.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

14.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

15.期末所有者权益指基金资产净值。

注:13.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

14.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

15.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

16.期末所有者权益指基金资产净值。

注:14.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

15.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

16.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

17.期末所有者权益指基金资产净值。

注:15.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

16.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

17.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

18.期末所有者权益指基金资产净值。

注:16.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

17.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

18.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

19.期末所有者权益指基金资产净值。

注:17.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

18.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

19.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

20.期末所有者权益指基金资产净值。

注:18.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

19.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

20.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

21.期末所有者权益指基金资产净值。

注:19.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

20.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

21.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

22.期末所有者权益指基金资产净值。

注:20.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

21.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

22.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

23.期末所有者权益指基金资产净值。

注:21.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

22.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

23.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

24.期末所有者权益指基金资产净值。

注:22.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

23.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

24.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

25.期末所有者权益指基金资产净值。

注:23.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

24.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

25.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

26.期末所有者权益指基金资产净值。

注:24.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

25.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

26.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

27.期末所有者权益指基金资产净值。

注:25.本基金实现收益指基金本期利息收入、已实现收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

26.所述本期利润不包括利润再投资所形成的可供分配利润。

27.基金本期利润指基金利润减去按规定提取的基金利润。

28.期末所有者权益指基金资产净值。

注:2