

大成优选混合型证券投资基金(LOF)

[2016] 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不存在虚假记载、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时,应向投资人充分揭示投资风险,投资人应根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金品种。

基金销售机构在销售基金时,应向投资人充分揭示投资风险,投资人应根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金品种。

本报告出自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成优选混合型证券投资基金(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
报告期末基金的份额总额	296,473,007.66份
投资目标	在有效控制风险的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将综合运用基本面、技术面和量化分析方法,确定大类资产配置比例,通过上市公司的基本面分析,选择具有估值优势的行业进行配置,获取超额收益。优选个股是本基金的投资策略,全面深入地分析上市公司的基本面,通过基本面分析,当股价低于合理估值时择机买入,买入后并长期持有。在股票投资过程中,分享股价提升带来的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+国债收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期收益及风险水平高于股票基金,低于债券基金与货币市场基金,属中高风险/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

	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期实现收益	8,706,480.00
2.本期利润	-89,227,040.77
3.期初现金基金份额总额	-3,000.00
4.期末现金基金净值	593,527,290.96
5.期末基金份额总额	2,964,730,007.66

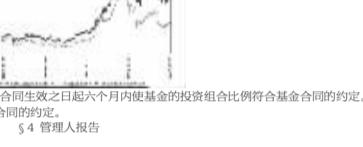
注:1.本期实现收益指基金本期收入总额减去总费用后的余额,其他收入不含公允价值变动收益减去相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列基金净值不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.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	净值增长率为(%)
过去三个月	-13.03%

3.2.2 本基金转型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:本基金根据合同约定,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。

建仓结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4.1 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理管理期限	证券从业年限	说明
戴欣先生	本基金基金经理,研究总监	2016年3月21日	5年	

注:1.任本基金期间,戴欣先生因工作原因从本基金辞职,由戴欣先生接替。

2.本基金定期报告的分析部分从行业协会、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合规性情况的说明

本报告期内,本基金的基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成优选混合型证券投资基金(LOF)》基金合同和其他有关法律法规的规定,在基金投资管理、基金运作、基金销售、基金宣传、信息披露等方面均不存在违法违规行为,基金没有发生违法违规行为,并严格履行了信息披露义务。

本基金在报告期内严格控制风险,在充分考虑风险和收益的情况下,努力为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 评估基金的可行性和合规性

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金托管人公平交易制度指导意见》的规定,公司制定了《大成基金管理有限公司公平交易制度》,《大成基金管理有限公司公平交易制度》对公平交易的原则、公平交易的范围、公平交易的实施、公平交易的监督和责任追究等进行了明确规定,公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.35 公平交易制度的执行情况

公司旗下所有投资组合均按照《公平交易制度》的规定执行,但存在与交易所公告的当日反向交易及交易对手方存在关联的机构的关联交易,在公平交易制度的执行上可能存在一定的影响。

4.3.36 公平交易制度的执行情况