

大成蓝筹稳健证券投资基金

[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规定，于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值情况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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 大成蓝筹稳健混合

交易代码 090003

前端交易代码 090003

后端交易代码 090103

基金运作方式 恒定开放型

基金合同生效日 2004年6月20日

报告期末基金总份额 5,094,420,204.54份

投资目标 本基金通过精选具有稳定经营基础、良好的盈利能力、合理的估值水平的公司股票，在控制系统性风险的前提下获取稳定的收益，同时通过长期持有并适时调整资产配置比例，有效控制整体风险，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金主要配置固定收益类金融工具，同时适当配置部分股票，在控制系统性风险的前提下，通过定期评估和动态调整资产配置比例，以达到资产配置的优化效果，通过精选具有稳定经营基础、良好的盈利能力、合理的估值水平的公司股票，在控制系统性风险的前提下获取稳定的收益，同时通过长期持有并适时调整资产配置比例，有效控制整体风险，实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 天相指数(股票)-7.0%+中债280指数-3.0%

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期风险与收益水平低于股票型基金，高于债券型基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标				
	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)			
1.本期初次收入	-263,242,592.36			
2.本期利润	-607,718,668.62			
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1192			
4.期末基金份额净值	3,000,288,004.16			
5.期末总资产净值	3,766,270,597.49			
6.期末净资产净值	3,000,288,004.16			
7.期末可供分配基金份额利润	2,966,460.00			
8.期末持有的现金及存出保证金	2,767,361,619.66			
9.期末持有的国债逆回购资金余额	0.00			
10.期末持有的其他金融资产	0.00			
11.期末持有的股票	612,777,977.26			
12.期末持有的其他投资	0.00			
13.期末持有的其他资产	727,485,266.11			
14.期末持有的待摊费用	0.00			
15.期末持有的其他负债	37,626,247.21			
16.期末持有的现金及存出保证金	3,690,463,100.16			
17.期末持有的国债逆回购资金余额	0.00			
18.期末持有的其他金融资产	0.00			
19.期末持有的股票	612,777,977.26			
20.期末持有的其他投资	0.00			
21.期末持有的其他资产	727,485,266.11			
22.期末持有的待摊费用	0.00			
23.期末持有的其他负债	37,626,247.21			
24.期末持有的现金及存出保证金	3,690,463,100.16			

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,计价费用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 本基金报告期内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(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准(%)
过去三个月	-14.43%	2.29%	-92.27%	17.1%

注:根据《大成蓝筹稳健混合型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准为2015年9月14日起,由“0%×天相280指数+30%×中信标普债指指数”变更为“7.0%×天相280指数+30%×中债综合指数”;基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.2 基金合同同生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

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标				
	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)			
1.本期初次收入	-263,242,592.36			
2.本期利润	-607,718,668.62			
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1192			
4.期末基金份额净值	3,000,288,004.16			
5.期末总资产净值	3,766,270,597.49			
6.期末净资产净值	3,000,288,004.16			
7.期末可供分配基金份额利润	2,966,460.00			
8.期末持有的现金及存出保证金	2,767,361,619.66			
9.期末持有的国债逆回购资金余额	0.00			
10.期末持有的其他金融资产	0.00			
11.期末持有的股票	612,777,977.26			
12.期末持有的其他投资	0.00			
13.期末持有的其他资产	727,485,266.11			
14.期末持有的待摊费用	0.00			
15.期末持有的其他负债	37,626,247.21			
16.期末持有的现金及存出保证金	3,690,463,100.16			

注:本报告期未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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.3 基金合同同生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

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标				
	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)			
1.本期初次收入	-263,242,592.36			
2.本期利润	-607,718,668.62			
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1192			
4.期末基金份额净值	3,000,288,004.16			
5.期末总资产净值	3,766,270,597.49			
6.期末净资产净值	3,000,288,004.16			
7.期末可供分配基金份额利润	2,966,460.00			
8.期末持有的现金及存出保证金	2,767,361,619.66			
9.期末持有的国债逆回购资金余额	0.00			
10.期末持有的其他金融资产	0.00			
11.期末持有的股票	612,777,977.26			
12.期末持有的其他投资	0.00			
13.期末持有的其他资产	727,485,266.11			
14.期末持有的待摊费用	0.00			
15.期末持有的其他负债	37,626,247.21			
16.期末持有的现金及存出保证金	3,690,463,100.16			

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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.4 基金合同同生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

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标				
	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)			