大成产业升级股票型证券投资基金(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	大成产业升级股票(LOF)
场内简称	大成产业
交易代码	160919
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2014年12月26日
报告期末基金份额总额	495,503,281.30份
投资目标	本基金重点投资于与产业升级主题相关的行业和企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。
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

3.1 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.本期已实现收益	-175,018,281.60
2.本期利润	-235,056,972.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4133
4.期末基金资产净值	550,201,805.47
5.期末基金份额净值	1.110

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(不含公允价值变动损益)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,计入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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-24.34%	3.12%	-10.70%	1.94%	-13.64%	1.18%

3.2.2 自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:按基金合同规定,基金管理人应当自基金转型之日起6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。

§4 管理人报告

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王文祥先生	本基金基金经理、研究部总监、社保基金及机构投资部总监	2014年12月26日	2016年1月11日	9年	清华大学工学硕士。2007年7月至2014年3月任职于长城基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、基金经理助理及长城双动力股票型证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。2014年3月加入大成基金管理有限公司,现任研究部总监。2014年7月26日至2014年12月25日任景福证券投资基金基金经理。2014年12月26日起至2016年1月11日任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。现兼任研究部总监和社保基金及机构投资部总监。具有基金从业资格。国籍:中国
李林益先生	本基金经理	2015年7月7日	-	5年	工学硕士。经济学学士。2011年6月加入大成基金管理有限公司。历任研究部研究员、基金经理助理。2015年7月7日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成产业升级股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中大成产业升级股票型证券投资基金的投资范围、投资比例、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等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《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异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在9笔同日反向交易,原因为投资策略需要;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

元旦前后,经济发生较大变化,最终表现为汇率的异常波动,进而触发多个恶性循环发生,由于制度层面的变化,进一步加剧了系统性风险的发生。基金虽然对相关风险做了应对,将此前基于短期逻辑的投资品种换为优质、白马类成长型标的,但最终防御的效果未能如意,净值发生了较大幅度的回撤。此后,基金调整了操作策略,主要投资于市场预期不充分,但正出现积极利好的周期性品种,成功的抓住了黄金、化工及资源品行情,一定程度上挽回了部分损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.110元,本报告期基金份额净值增长率为-24.34%,同期业绩比较基准收益率为-10.70%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	478,562,932.59	86.12
	其中:股票	478,562,932.59	86.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	74,473,437.76	13.40
8	其他资产	2,683,896.31	0.48
9	合计	555,720,266.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	44,905,025.49	8.16
C	制造业	324,971,124.87	59.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	22,187,848.00	4.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,294,042.00	4.23
J	金融业	23,025,116.40	4.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,851,996.32	2.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	478,562,932.59	86.98

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600990	四创电子	441,478	35,093,086.22	6.38
2	000034	深信泰丰	1,311,463	27,291,545.03	4.96
3	002414	高德红外	1,124,560	26,595,844.00	4.83
4	600547	山东黄金	923,676	24,283,442.04	4.41
5	002230	科大讯飞	718,300	23,287,286.00	4.23
6	601398	工商银行	5,367,160	23,025,116.40	4.18
7	000089	深圳机场	2,692,700	22,187,848.00	4.03
8	600060	海信电器	1,288,960	21,448,294.40	3.90
9	002594	比亚迪	360,378	21,193,830.18	3.85
10	600276	恒瑞医药	446,300	21,078,749.00	3.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,667,050.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,747.67
5	应收申购款	98.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,683,896.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000034	深信泰丰	27,291,545.03	4.96	重大事项
2	002230	科大讯飞	23,287,286.00	4.23	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	637,509,104.00
报告期期间基金总申购份额	8,258,539.81
减:报告期期间基金总赎回份额	150,264,362.51
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	495,503,281.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,500,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	7,500,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.51

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)的文件;
2、《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)托管协议》;
4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年4月22日

大成创新成长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	大成创新成长混合
场内简称	大成创新
交易代码	160910
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年6月12日
报告期末基金份额总额	2,410,441,432.68份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,超越业绩比较基准,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以股票投资为主,采用积极的投资策略,精选具备持续增长能力,价格处于合理区间的优质股票构建投资组合;本基金以固定收益品种投资为辅,确保投资组合具有良好的流动性。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险的证券投资基金品种。
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

3.1 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.本期已实现收益	-195,357,299.22
2.本期利润	-558,236,560.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2317
4.期末基金资产净值	2,321,270,760.36
5.期末基金份额净值	0.963

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。

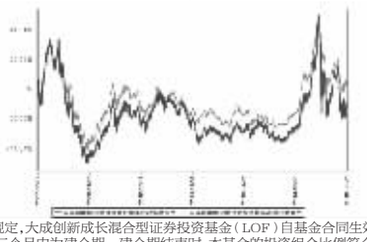
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.48%	3.02%	-9.20%	1.70%	-10.28%	1.32%

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,大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)自基金合同生效(暨基金转型)之日2007年6月12日起三个月内为建仓期。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。

§4 管理人报告

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏庆国先生	本基金基金经理	2015年7月28日	-	6年	经济学硕士。2010年至2012年任职于华夏基金管理有限公司研究部研究员;2012年至2013年任职于平安大华基金研究部;2013年5月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日至2015年3月30日担任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理助理。2015年4月7日至2015年7月23日起担任大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年7月24日起任大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年4月7日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015年7月28日起任大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2016年3月22日起任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成创新成长混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成创新成长混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、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等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《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异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2016年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在9笔同日反向交易,原因为投资策略需要;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在2笔同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度是对本基金管理人挑战最大的一个季度,从开年的连续熔断导致减仓失败,到后面供给侧改革,再转瞬切换为需求刺激,再到担忧通胀导致货币政策无法进一步宽松,市场和政策都反复多变。

本基金一直坚持稳定的5类选股模式,重点投资以下几类股票:1)成长股:类VC阶段的成长股、经典成长股和泡沫化阶段的成长股;2)重大资产重组导致企业基本面发生彻底变化,复牌后第二波投资机会;3)强者恒强的热门股;4)超跌反弹;5)有基本面支撑中枢震荡突破。除此之外,由于战略新兴板被取消、注册制被推后,壳公司成为一个重要的投资方向,主要思路就是:市值小、壳干净(人少、负债少、没有诉讼或者处罚)、有动力(曾经借壳失败、有PE举牌)。

本基金依然坚持以个股仓位分层为核心的资金管理系统,通过个股仓位的动态调整,实现个股和整个组合的有纪律的进攻性。

从一季度操作来看,本基金出现了不少失误之处:1)开年的减仓失败,部分原因是因为熔断机制导致无法交易,部分是因为自己的心态不够坚决;2)1月底以来的行情中,其实高送转、智能驾驶和互联网金融等板块出现了不少大涨的股票,没有积极参与,这个一直是困扰投资的一个问题,如何把发现的机会,转为重仓买入,部分是"知"的不到位研究不深入,部分是"勇"的不够,缺乏杀伐决断;3)对于各个行业的基本面研究、对于个股的技术走势的分析需要进一步的深化,杜绝模糊不清的认识。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为0.963元,本报告期基金份额净值增长率为-19.48%,同期业绩比较基准收益率为-9.20%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,737,714,391.46	74.60
	其中:股票	1,737,714,391.46	74.60
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	586,528,788.59	25.18
8	其他资产	5,257,058.00	0.23
9	合计	2,329,500,238.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,048,073,417.06	45.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	124,127,176.94	5.35
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	22,017,072.00	0.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,831,788.47	9.51
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	91,392,675.00	3.94
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	131,658,590.00	5.67
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	99,613,671.99	4.29
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	1,737,714,391.46	74.86

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300342	天银机电	3,880,304	142,717,581.12	6.15
2	300008	上海佳豪	5,283,250	131,658,590.00	5.67
3	002094	青岛金王	4,356,341	100,195,843.00	4.32
4	600661	新南洋	3,129,553	99,613,671.99	4.29
5	603398	邦宝益智	1,325,341	97,227,015.76	4.19
6	000526	银润投资	1,661,685	91,392,675.00	3.94
7	002730	电光科技	2,214,807	90,784,938.93	3.91
8	600386	北巴传媒	4,623,497	75,363,001.10	3.25
9	300047	天源迪科	3,936,541	72,786,643.09	3.14
10	000590	*ST古汉	3,256,224	69,618,069.12	3.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,937,790.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	116,601.46
5	应收申购款	202,665.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,257,058.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002730	电光科技	90,784,938.93	3.91	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,402,138,706.82
报告期期间基金总申购份额	38,807,281.72
减:报告期期间基金总赎回份额	30,504,555.86
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,410,441,432.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》;
2、《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年4月22日

大成丰财宝货币市场基金

【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	大成丰财宝货币	
交易代码	000626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月18日	
报告期末基金份额总额	109,982,372.06份	
投资目标	在有效控制投资组合风险,保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	
下属分级基金的基金简称	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
下属分级基金的交易代码	000626	000627
报告期末下属分级基金的份额总额	54,019,293.37份	55,963,078.68份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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)	
	大成丰财宝货币A	大成丰财宝货币B
1. 本期已实现收益	483,898.96	444,643.37
2. 本期利润	483,898.96	444,643.37
3. 期末基金资产净值	54,019,293.37	55,963,078.68

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成丰财宝货币A

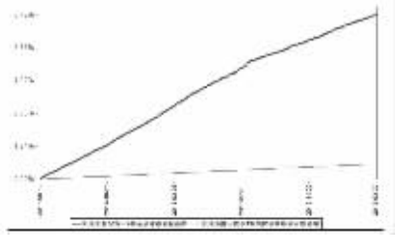
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6684%	0.0061%	0.0870%	0.0000%	0.5814%	0.0061%

大成丰财宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7287%	0.0061%	0.0870%	0.0000%	0.6417%	0.0061%

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同规定,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。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄海峰先生	本基金基金经理	2014年12月24日	-	12年	南开大学经济学学士。2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23