

# 信息披露

# disclosure

(上接B01版)

客服电话:400-818-8118  
 联系人:黄静  
 电话:010-84183333  
 传真:010-84183311-3389  
 网站:www.guodu.com  
 71. 东海证券股份有限公司  
 注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼  
 办公地址:上海市东方路1928号东海证券大厦  
 法定代表人:朱科敏  
 客服电话:96631  
 联系人:梁旭  
 电话:021-20333333  
 传真:021-50496625  
 网站:www.longone.com.cn  
 72. 恒泰证券股份有限公司  
 注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号  
 法人代表:席广民  
 客服电话:0471-4961259  
 联系人:魏巍  
 电话:0471-3953168  
 传真:0471-4930707  
 73. 国盛证券有限责任公司  
 注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦  
 办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼  
 法定代表人:徐丽峰  
 联系人:周欣玲  
 电话:0791-86281305;13803512671  
 传真:0791-86281305  
 网站:www.gsstock.com  
 74. 华西证券股份有限公司  
 注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
 法定代表人:杨炯洋  
 客户服务热线:4008888818  
 联系人:金达勇  
 电话:0756-83025723  
 传真:0756-83025991  
 网站:www.hx168.com.cn  
 75. 中泰证券股份有限公司  
 办公地址:山东省济南市经十路20518号  
 法定代表人:李玮  
 客服电话:96538  
 联系人:吴阳  
 电话:0531-81283938  
 传真:0531-81283900  
 网站:www.qtzq.com.cn  
 76. 世纪证券有限责任公司  
 办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼  
 法定代表人:姜昧军  
 客服电话:0756-83199699  
 联系人:袁媛  
 电话:0756-83199611  
 传真:0756-83199645  
 网站:www.csco.com.cn  
 77. 第一创业证券股份有限公司  
 办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25F  
 法人代表:刘学民  
 电话:96358  
 网站:www.firstcapital.com.cn  
 78. 中航证券有限公司  
 注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼  
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼  
 法人代表:王宜四  
 客户服务热线:4008866657  
 联系人:戴璐  
 电话:0791-86768681  
 传真:0791-86770178  
 网站:www.avicsec.com  
 79. 华林证券股份有限公司  
 注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1君泰国际B栋一层3号  
 办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼  
 法定代表人:林立  
 客服电话:400-188-3888  
 联系人:李琳  
 电话:0756-82707857  
 传真:0756-23613751  
 网站:www.chinalions.com  
 80. 华福证券有限责任公司  
 注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
 法定代表人:黄金雄  
 客服电话:0691-96326  
 联系人:张宗锐  
 电话:0591-87383600  
 传真:0591-87841150  
 网站:www.gfhfzq.com.cn  
 81. 华龙证券有限责任公司  
 注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号  
 法定代表人:韩鹏  
 联系人:杨晓天  
 客服电话:0931-8784509  
 传真:0931-4890910  
 甘肃省客服电话:96668  
 网站:www.hljzgs.com  
 82. 中国国际金融有限公司  
 注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
 办公地址:北京市建国门外大街甲6号SK大厦  
 法定代表人:丁学东  
 联系人:杨涵宇  
 电话:010-65051166  
 网站:www.ciccs.com.cn  
 83. 财通证券有限责任公司  
 注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心  
 法定代表人:沈继宁  
 客户联系电话:0571-96336(上海地区:962336)  
 联系人:乔骏  
 电话:0571-87925129  
 传真:0571-87925100  
 网站:www.ctsec.com  
 84. 上海海证有限责任公司  
 注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
 法定代表人:郭林  
 客服电话:4008205999  
 联系人:李颀  
 电话:021-38784814  
 传真:021-68774818  
 网站:www.shhxzq.com  
 85. 华鑫证券有限责任公司  
 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01  
 (b) 办公地址:上海市肇嘉浜路750号  
 法定代表人:俞肇荣  
 联系人:陈敏  
 网站:www.cfsc.com.cn  
 客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918  
 86. 瑞银证券股份有限公司  
 注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
 法定代表人:程宜秋  
 电话:010-58328373  
 传真:010-58328748  
 网站:www.hsbcsec.com.cn  
 87. 中国中投证券有限责任公司  
 注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元  
 办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
 法定代表人:高涛  
 联系人:刘璇  
 客户电话:400 600 8002  
 电话:0756-8202344  
 传真:0756-82026539  
 网站:www.china-invocs.com  
 88. 中山证券有限责任公司  
 注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层  
 法定代表人:黄锦辉  
 联系人:罗艺琳  
 联系电话:0755-82570586  
 客服电话:400-1022-011  
 网站:www.zszq.com.cn  
 89. 国融证券股份有限公司  
 注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼  
 法定代表人:张智河  
 联系电话:95385; 400-660-9839  
 网站:www.grzq.com.cn  
 90. 联讯证券股份有限公司  
 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心3001室  
 法定代表人:周斌  
 客服电话:400890618  
 网站:www.chtund.com  
 115. 北京汇成基金销售有限公司  
 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108  
 法定代表人:王伟刚  
 联系人:闫楠  
 电话:010-56221240  
 传真:010-62680827  
 客服电话:400-619-9069  
 网站:www.fundzone.cn  
 116. 北京晟视天下投资管理有限公司  
 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室  
 法定代表人:蒋煜  
 联系人:孙悦  
 电话:010-58170823  
 传真:010-58170800  
 客服电话:400-818-8866  
 网站:http://fund.shengshiview.com  
 117. 北京乾景基金销售有限公司  
 注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦(丹棱soho)1001室  
 法定代表人:赵荣春  
 联系人:魏春  
 网站:www.qianjing.com  
 客服电话:400-893-6885  
 118. 上海万得投资顾问有限公司  
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座  
 办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼  
 法定代表人:王廷富  
 联系人:姜义军  
 联系电话:021-5132 7185  
 传真:021-5071 0161  
 客服电话:400-821-0203  
 119. 泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司  
 注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场龙园3号  
 法定代表人:林卓  
 联系人:张帆  
 电话:0411-88891212  
 传真:0411-84386336  
 客服电话:400-6411-999  
 网站:www.taichengcaifu.com  
 120. 上海基煜基金销售有限公司  
 注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)  
 办公地址:上海市杨浦区昆明路518号a1002室  
 法定代表人:王翔  
 联系人:安彬  
 客服电话:(021)6537 0077  
 网站:www.jiyufund.com.cn  
 121. 上海凯石财富基金销售有限公司  
 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
 法定代表人:陈维武  
 客服电话:4000178000  
 联系人:葛佳蕊  
 电话:021-63333319  
 传真:021-63332523  
 网站:www.wstonewealth.com  
 122. 上海中正达广投资管理有限公司  
 注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  
 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼  
 法定代表人:黄欣  
 公司电话:021-3376 8132  
 客服电话:400-676-523  
 网站:http://www.zzwzwealth.cn/  
 123. 北京虹点基金销售有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元  
 办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元  
 法定代表人:胡伟  
 传真:010-65961887  
 电话:010-65961887  
 客服电话:400-618-0707  
 网站:www.hongdiandfund.com  
 124. 武汉市伯嘉基金销售有限公司  
 注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7楼23层19、4号  
 法定代表人:陶捷  
 联系人:杨帆  
 电话:027-87006003/87006009  
 网站:www.buoyfund.com  
 公司传真:027-87006010  
 客服电话:400-027-9899  
 125. 上海陆金所资产管理有限公司  
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  
 法定代表人:郭坚  
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
 联系人:宁宇竹  
 客服电话:4008219031  
 网站:www.lufunds.com  
 126. 珠海盈米财富管理有限公司  
 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491  
 法定代表人:肖雯  
 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203  
 联系人:黄敏娜  
 网站:www.yingmi.cn  
 客服电话:020-89629066  
 127. 和耕传承基金销售有限公司  
 注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间  
 办公地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间  
 法定代表人:李淑敏  
 客服电话:4000-555-671  
 网站:http://www.hggcpb.com/  
 128. 奕丰金融服务(深圳)有限公司  
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)  
 办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室  
 法定代表人:TAN YIK KUAN  
 联系人:叶健  
 电话:0756-89460607  
 传真:0756-21674453  
 客服电话:400-684-0600  
 网站:www.ifastps.com.cn  
 129. 北京肯特瑞财富投资管理有限公司  
 注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06  
 办公地址:北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院楼  
 京东集团总部  
 法定代表人:江卉  
 电话:个人业务95118, 400 098 8511、企业业务400 088 8816  
 传真:010-8919566  
 网站:fund.jd.com  
 130. 深圳市金斧子基金销售有限公司  
 注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼  
 办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼  
 法定代表人:赖建文  
 联系人:张烨  
 电话:0756-66892301  
 传真:0756-26892330  
 客服电话:400-950-0888  
 网站:www.jfzinv.com  
 131. 北京莱君基金销售有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层22205  
 法定代表人:钟斐斐  
 客服电话:4000618518  
 联系人:袁永娟  
 电话:010-61840688  
 传真:010-61840639  
 网站:https://danjiaonapp.com  
 (二) 注册服务机构  
 名称:大成基金管理有限公司  
 住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层  
 办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层  
 法定代表人:刘明  
 电话:0756-83183388  
 传真:0756-83195239  
 联系人:黄基平  
 (三) 律师事务所和经办律师  
 律师事务所名称:通力律师事务所  
 注册地址:上海市浦东新区银城中路28号上海证券大厦南塔21楼  
 办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼  
 经办律师:秦悦民、傅秋  
 电话:021-68818100  
 传真:021-68816880  
 (四) 会计师事务所和经办注册会计师  
 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼  
 办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中国11楼  
 执行事务合伙人:李丹  
 电话:021-23238189  
 联系人:俞伟敏  
 经办注册会计师:张振波、俞伟敏  
 四、基金名称  
 大成精选增值混合型证券投资基金  
 五、基金的类型  
 基金类型:契约型  
 六、基金的运作方式  
 基金运作方式:开放式  
 七、基金的投资目标  
 投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业,为投资者寻求持续稳定的投资价值  
 八、基金的投资范围  
 投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券,以及法律、法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资比例范围为基金资产的40%-95%,为了满足投资者赎回要求,基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,债券投资比例范围为基金资产的0%-55%。  
 九、基金的投资策略  
 本基金利用大成基金自行开发的股票管理流程,采用“自上而下”资产配置和行业配置、“自下而上”精选股票的投资策略,主要投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业股票,通过积极主动的投资策略,追求基金资产的长期资本增值。  
 本基金股票投资流程如下图所示:

(1) 资产配置

根据宏观经济指标、市场价值指标、投资者气象指标、盈利预测指标、证券市场流动性指标等相关因素的综合分析,对股票、债券的风险和收益率进行预测。利用情景分析对上述预测进行分析,确定股票投资组合的资产配置比例。  
 (2) 行业配置  
 本基金通过定性定量的方法确定行业资产配置比例。  
 基金管理人将根据对宏观经济变化及行业结构调整的分析判断,确定行业配置比例。  
 确定行业配置的主要依据为:根据竞争优势分析,确定行业中具有竞争优势和比较竞争优势的行业范围。根据多因素模型分析确定每个行业内在价值,以及行业价格向内在价值回归的速度,结合均值方差分析确定行业配置比例范围。  
 行业配置的主要步骤为:  
 ① 通过以下分析,确定行业相对投资价值  
 对全球、地区、国内行业发展趋势和发展环境进行分析,判断行业或产品的增长前景(全球观念下,行业景气趋势分析)  
 宏观经济周期对行业发展的影响(宏观分析)  
 优势行业的发展模式分析(评价商业模式)  
 该行业财务状况分析(财务稳健性分析)  
 ② 根据多因素模型分析,确定行业配置比例范围  
 利用多因素模型通过对宏观经济变量、价值变量、增长变量、盈利变量、动量变量等多种因素指标的定量分析,确定每个行业内在价值,以及行业价格向内在价值回归的速度,利用结合均值方差分析有效边界确定行业配置比例范围。  
 分析模式可以分为三步:  
 第一步利用长期模型估计每个行业和影响其基本因素的长期依赖关系,同时估计行业价值与其内在价值的偏离程度,这里我们利用DDM模型作为估计行业内在价值的框架模型。  
 第二步结合经验和实证分析结论,对不同行业设定不同的影响因素,利用短期动态模型分析每个行业价值向其内在价值回归的速度和各行业收益率的预测水平。  
 第三步利用定性和定量相结合的方式,确定优势行业,结合均值-方差分析确定行业投资组合比例范围。  
 (3) 个股选择  
 ① 首先对股票市值大小进行排序,挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票,作为模型的基础股票库。  
 ② 对股票投资价值 and 股票预期收益增长性进行定量分析与评分筛选:  
 通过选取与股价变动有较强相关性的每股预期收益增长率、市盈率、市净率、市销率(P/S)、流通市值等基本因素和技术因素为指标,对基础股票库中各行业股票的投资价值和预期收益增长性进行定量分析与评分筛选,在剔除掉通过不公平关联交易、非经常性收益等方式实现净利润大幅增长的个股后,组成股票备选库(本基金将新股申购作为一个特殊资产类看待,单独管理)。  
 ③ 通过商业评估、公司评估、价值评估、盈利预期和市场表现对备选股票库上市公司进行综合分析,按照比较后的优先顺序,在备选股票库中寻找价格合理、基本面良好、具有一定上涨空间的股票。  
 (4) 构建执行投资组合  
 基金经理按以下步骤建立投资组合:  
 ① 对当前的投资策略进行分析评估;  
 ② 基于“自上而下”进行的资产配置与行业配置,基于“自下而上”选择的股票,结合基金经理自身的研究分析,构建、执行投资组合。  
 本基金为风险收益中等偏高的基金产品,充分重视对债券的投资。债券投资时,将综合考虑利率变化对不同债券的收益率水平、信用风险、流动性等因素的影响,利用债券定价模型对债券价值进行分析,确定债券投资组合。基金经理统一负责本基金的债券投资。根据投资决策委员会确定的资产配置比例,并结合资金量及流动性要求提出债券投资执行方案。  
 (5) 业绩风险控制  
 金融工程部运用大成基金管理有限公司风险控制模型,对投资组合的风险构成进行度量预测分析。基金经理跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况,以及对基金投资组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。监察稽核部负责对基金投资过程进行日常监督。  
 十、基金的业绩比较基准  
 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A600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%”变更为“沪深300指数×75%+中国国债总指数×25%”。  
 十一、基金的风险收益特征  
 本基金为混合型理财,属于证券投资基金中预期风险和预期收益适中的品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。  
 十二、基金的投资组合报告  
 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根据基金合同规定,于2017年12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、误导性陈述或重大遗漏。  
 本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。  
 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	1,453,008,730.33	86.66
2	基金投资	1,453,008,730.33	86.66
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	100,000,000.00	5.96
	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	12,328,672.01	0.63
8	其他资产	14,096,862.50	0.84
9	合计	1,676,637,388.94	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	0.00
B	采矿业	2,640,727.09	0.16
C	制造业	831,017,721.25	50.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	69,287,270.4	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	32,003,400.56	1.94
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	76,852,441.21	4.64
J	金融业	104,324,845.50	6.31
K	房地产业	39,343,500.00	2.38
L	租赁和商务服务业	114,329,376.09	6.96
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	56,335,769.20	3.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	66,609,526.24	3.97
R	文化、体育和娱乐业	116,589,792.25	7.06
S	综合	-	0.00
	合计	1,453,008,730.33	87.92

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300144 荣泰国际	5,465,280	0.32
2	300072 三聚环保	2,766,203	0.17
3	002606 三花智控	5,161,861	0.31
4	002640 跨境通	2,096,605	0.13
5	002653 海康威视	3,831,630	0.23
6	002127 南极电商	3,821,379	0.23
7	000063 中兴通讯	2,048,473	0.13
8	002044 美年健康	3,351,626	0.20
9	000991 华鲁恒升	3,72,548	0.23
10	002027 安洁科技	5,462,240	0.33

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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资产组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

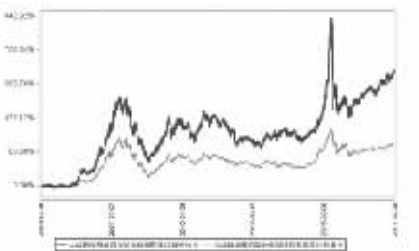
(3) 本期国债期货投资评价

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	514,049.23
2	应收证券清算款	13,318,112.47
3	应收利息	-
4	应收股利	62,564.90
5	应收申购款	171,256.00
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	14,005,982.50

(4) 报告期末基金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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
 本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

(6) 由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。  
 十三、基金业绩  
 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
 (一) 自基金合同生效日(为2004年12月15日),至2017年9月30日基金合同生效以来完整会计年度的基金份额净值增长率投资业绩以及与同期业绩比较基准收益率的比较:  

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2004.12.15-2004.12.31	0.08%	0.09%	-2.71%	0.81%	2.79%	-0.72%
2005.01.01-2005.12.31	-0.26%	0.89%	-6.39%	1.03%	6.13%	-0.14%
2006.01.01-2006.12.31	16.05%	1.55%	83.15%	1.06%	67.40%	0.50%
2007.01.01-2007.12.31	124.66%	2.08%	104.14%	1.72%	20.52%	0.36%
2008.01.01-2008.12.31	-52.60%	2.13%	-52.51%	2.28%	0.01%	-0.15%
2009.01.01-2009.12.31	76.92%	1.92%	67.45%	1.53%	8.47%	0.39%
2010.01.01-2010.12.31	1.79%	1.05%	-4.36%	1.17%	6.14%	0.53%
2011.01.01-2011.12.31	-28.40%	1.26%	-17.97%	0.97%	-10.49%	0.29%
2012.01.01-2012.12.31	6.02%	1.19%	6.07%	0.96%	-0.05%	0.23%
2013.01.01-2013.12.31	10.32%	1.32%	-5.88%	1.16%	16.20%	0.27%
2014.01.01-2014.12.31	14.62%	1.26%	40.83%	0.91%	-26.01%	0.34%
2015.01.01-2015.12.31	27.24%	2.67%	7.73%	1.86%	19.51%	0.71%
2016.01.01-2016.12.31	7.91%	1.41%	-7.87%	1.06%	15.78%	0.36%
2017.01.01-2017.09.30	13.11%	0.73%	11.68%	0.43%	1.43%	0.30%
2004.12.15-2017.09.30	640.40%	1.62%	232.87%	1.33%	407.53%	0.20%

 (二) 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较:  
 大成精选增值基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势对比图  

 (2004年12月15日至2017年9月30日)  
 注:1、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。建仓期结束后,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基金合同》的相关规定,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A600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%”变更为“沪深300指数×75%+中国国债总指数×25%”。  
 十四、费用概览  
 (一) 与基金运作有关的费用  
 1. 与基金运作相关费用列示  
 (1) 基金管理人的管理费;  
 (2) 基金托管人的托管费;  
 (3) 基金的销售交易费用;  
 (4) 基金合同生效后的信息披露费用;  
 (5) 基金份额持有人大会费用;  
 (6) 基金合同生效后的会计师费;  
 (7) 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。  
 2. 与基金运作相关费用计提方法、计提标准和支付方式  
 (1) 基金管理人的管理费  
 基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:  

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

$$H$$
为每日应计提的基金管理费  

$$E$$
为前一日基金资产净值  
 基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。  
 (2)