

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)

2009 第三季度报告

2009年9月30日

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, and dates.

投资目标
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,保持投资组合具有良好的流动性。

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,保持投资组合具有良好的流动性。

业绩比较基准
沪深300指数*90%+中国债券总指数*10%

风险收益特征
本基金为混合型基金,风险收益水平高于纯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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 1,150,988,750.37
2.本期利润 -410,839,135.49
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0286
4.期末基金份额净值 11,464,215.44955

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:本基金合同约定,大成创新成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, etc. Manager information.

注:1.在报告期内,兼任过本基金的基金经理职务满12个月;
2.证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金管理人恪守《证券投资基金法》、《大成创新成长混合型证券投资基金合同》及其他有关法律法规的规定,在基金管理人运作中,大成创新成长混合型证券投资基金的投资范围、投资策略、证券交易行为均符合有关法律法规的规定,未发现基金管理人有违法违规从事证券投资活动,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人存在违法违规行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人存在违法违规行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
公司严格执行《公平交易管理制度》(《公平交易管理制度》)公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的基金经理、投资决策、股票、债券、期货交易以及不同时间间隔(日内、5日内、10日内)向同一交易对手的交易价格和交易规模等。

Table with 3 columns: Period, Fund Name, Net Growth Rate. Comparison of investment returns.

4.3.3 异常交易专项说明
本报告期本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩比较基准执行情况
回顾总结 2009 年上半年以来,3 季度呈现周期波动的特征,如果从 09 年上半年行情的波动力是来自于过度宽松的货币政策以及对宏观经济不断好转的预期,那么在进入 3 季度后市场的大幅调整,可以说宏观基本面和市场情绪均发生逆转。

我们回顾和总结 3 季度的宏观经济环境以及市场的特征之可以观察到,导致市场从 3000 点出现大幅调整的主要原因在于支持上半年市场大幅上涨的主要因素在 3 季度发生逆转:1. 货币政策,过度宽松的货币政策是市场大幅调整的重要原因,信贷投放量过大,流动性过剩,通胀压力加大,央行加息,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧。

3.69% 低于业绩比较基准的组合。
5.1 报告期本基金资产组合情况

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Fund basic information.

投资目标
在力求本金安全和保持资产流动性地基础上追求资产长期稳定增值。

投资策略
通过精选资产配置,在固定收益资产和权益资产三个层次自上而下地进行投资管理,以获取稳定收益,同时通过积极参与新股申购,把握新股发行带来的投资机会。

业绩比较基准
中国债券总指数

风险收益特征
无

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 2,450,930.79
2.本期利润 -286,906.77
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0009
4.期末基金份额净值 156,576.33321

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:1.本基金于 2006 年 4 月 24 日起执行新的收费模式,将申购费模式定义为 A 收费模式,后端收费模式定义为 B 收费模式,二者对应的基金名称称“大成债券 A”,将申购费模式定义为 C 收费模式,对应的基金名称称“大成债券 C”。

为 B 收费模式,二者对应的基金名称称“大成债券 A”,将申购费模式定义为 C 收费模式,对应的基金名称称“大成债券 C”。

大成沪深 300 指数证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Fund basic information.

投资目标
本基金为被动式指数跟踪基金,通过跟踪标的指数表现追求跟踪标的指数的收益率,力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不得超过 4%。

投资策略
本基金采用被动式指数跟踪策略,原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重进行构建;复制标的指数,并原则上根据标的指数的成份股及其权重进行构建。

业绩比较基准
沪深 300 指数

风险收益特征
本基金为指数基金,属于中高风险,其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 16,515,413.35
2.本期利润 -393,086,643.10
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0588
4.期末基金份额净值 7,022,369,425.74

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:本基金合同约定,大成沪深 300 指数证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, etc. Manager information.

注:1.在报告期内,兼任过本基金的基金经理职务满 12 个月;
2.证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金管理人恪守《证券投资基金法》、《大成沪深 300 指数证券投资基金合同》及其他有关法律法规的规定,在基金管理人运作中,大成沪深 300 指数证券投资基金的投资范围、投资策略、证券交易行为均符合有关法律法规的规定,未发现基金管理人有违法违规从事证券投资活动,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人存在违法违规行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
公司严格执行《公平交易管理制度》(《公平交易管理制度》)公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的基金经理、投资决策、股票、债券、期货交易以及不同时间间隔(日内、5日内、10日内)向同一交易对手的交易价格和交易规模等。

Table with 3 columns: Period, Fund Name, Net Growth Rate. Comparison of investment returns.

4.3.3 异常交易专项说明
本报告期本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩比较基准执行情况
回顾总结 2009 年上半年以来,3 季度呈现周期波动的特征,如果从 09 年上半年行情的波动力是来自于过度宽松的货币政策以及对宏观经济不断好转的预期,那么在进入 3 季度后市场的大幅调整,可以说宏观基本面和市场情绪均发生逆转。

我们回顾和总结 3 季度的宏观经济环境以及市场的特征之可以观察到,导致市场从 3000 点出现大幅调整的主要原因在于支持上半年市场大幅上涨的主要因素在 3 季度发生逆转:1. 货币政策,过度宽松的货币政策是市场大幅调整的重要原因,信贷投放量过大,流动性过剩,通胀压力加大,央行加息,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧。

3.69% 低于业绩比较基准的组合。
5.1 报告期本基金资产组合情况

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Fund basic information.

投资目标
本基金为被动式指数跟踪基金,通过跟踪标的指数表现追求跟踪标的指数的收益率,力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不得超过 4%。

投资策略
本基金采用被动式指数跟踪策略,原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重进行构建;复制标的指数,并原则上根据标的指数的成份股及其权重进行构建。

业绩比较基准
沪深 300 指数

风险收益特征
本基金为指数基金,属于中高风险,其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 16,515,413.35
2.本期利润 -393,086,643.10
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0588
4.期末基金份额净值 7,022,369,425.74

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:本基金合同约定,大成沪深 300 指数证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, etc. Manager information.

注:1.在报告期内,兼任过本基金的基金经理职务满 12 个月;
2.证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Fund basic information.

投资目标
本基金为被动式指数跟踪基金,通过跟踪标的指数表现追求跟踪标的指数的收益率,力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不得超过 4%。

投资策略
本基金采用被动式指数跟踪策略,原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重进行构建;复制标的指数,并原则上根据标的指数的成份股及其权重进行构建。

业绩比较基准
沪深 300 指数

风险收益特征
本基金为指数基金,属于中高风险,其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 16,515,413.35
2.本期利润 -393,086,643.10
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0588
4.期末基金份额净值 7,022,369,425.74

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:本基金合同约定,大成沪深 300 指数证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, etc. Manager information.

注:1.在报告期内,兼任过本基金的基金经理职务满 12 个月;
2.证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金管理人恪守《证券投资基金法》、《大成沪深 300 指数证券投资基金合同》及其他有关法律法规的规定,在基金管理人运作中,大成沪深 300 指数证券投资基金的投资范围、投资策略、证券交易行为均符合有关法律法规的规定,未发现基金管理人有违法违规从事证券投资活动,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为,未发现基金管理人存在违法违规行为,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
公司严格执行《公平交易管理制度》(《公平交易管理制度》)公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的基金经理、投资决策、股票、债券、期货交易以及不同时间间隔(日内、5日内、10日内)向同一交易对手的交易价格和交易规模等。

Table with 3 columns: Period, Fund Name, Net Growth Rate. Comparison of investment returns.

4.3.3 异常交易专项说明
本报告期本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩比较基准执行情况
回顾总结 2009 年上半年以来,3 季度呈现周期波动的特征,如果从 09 年上半年行情的波动力是来自于过度宽松的货币政策以及对宏观经济不断好转的预期,那么在进入 3 季度后市场的大幅调整,可以说宏观基本面和市场情绪均发生逆转。

我们回顾和总结 3 季度的宏观经济环境以及市场的特征之可以观察到,导致市场从 3000 点出现大幅调整的主要原因在于支持上半年市场大幅上涨的主要因素在 3 季度发生逆转:1. 货币政策,过度宽松的货币政策是市场大幅调整的重要原因,信贷投放量过大,流动性过剩,通胀压力加大,央行加息,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧,市场预期货币政策将收紧。

3.69% 低于业绩比较基准的组合。
5.1 报告期本基金资产组合情况

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:2009年10月27日

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。

Table with 2 columns: Item and Value. Fund basic information.

投资目标
本基金为被动式指数跟踪基金,通过跟踪标的指数表现追求跟踪标的指数的收益率,力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不得超过 4%。

投资策略
本基金采用被动式指数跟踪策略,原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重进行构建;复制标的指数,并原则上根据标的指数的成份股及其权重进行构建。

业绩比较基准
沪深 300 指数

风险收益特征
本基金为指数基金,属于中高风险,其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期 2009年7月1日-2009年9月30日

Table with 2 columns: Item and Value. Financial indicators for the period.

1.本期已实现收益 16,515,413.35
2.本期利润 -393,086,643.10
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0588
4.期末基金份额净值 7,022,369,425.74

5.1 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。
5.2 本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

Table with 6 columns: Period, Net Growth, etc. Performance comparison table.

注:本基金合同约定,大成沪深 300 指数证券投资基金自基金合同生效之日起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, etc. Manager information.

注:1.在报告期内,兼任过本基金的基金经理职务满 12 个月;
2.证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。