

大成财富管理 2020 生命周期基金 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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

1 重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2 基金产品概况
本基金名称:大成2020生命周期混合
基金代码:090006
基金运作方式:契约型开放式

3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标
1.本期已实现收益 742,477,368.98
2.本期利润 -404,818,788.21
3.加权平均基金份额本期利润 -0.02049
4.期末基金资产净值 10,113,712,026.19

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 9,051,192,372.96 89.09

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 76,231,653.76 0.75

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 601169 北京银行 37,678,189 649,195,196.47 6.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 452,932,000.00 4.48

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十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 09001038 09央行票据38 3,000,000 294,470,000.00 2.92

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
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权证投资明细
5.8 本报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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备选股票库之外的股票。
5.9.2 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备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产
5.9.4 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.5 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.6 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.7 影响投资者决策的其他重要信息
5.9.8 备查文件目录
5.9.9 备查文件目录
5.9.10 备查文件目录

5.9.11 备查文件目录
5.9.12 备查文件目录
5.9.13 备查文件目录

5.9.14 备查文件目录
5.9.15 备查文件目录
5.9.16 备查文件目录

5.9.17 备查文件目录
5.9.18 备查文件目录
5.9.19 备查文件目录

5.9.20 备查文件目录
5.9.21 备查文件目录
5.9.22 备查文件目录

5.9.23 备查文件目录
5.9.24 备查文件目录
5.9.25 备查文件目录

5.9.26 备查文件目录
5.9.27 备查文件目录
5.9.28 备查文件目录

大成积极成长股票型证券投资基金 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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

1 重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2 基金产品概况
本基金名称:大成积极成长股票
基金代码:090007
基金运作方式:契约型开放式

3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标
1.本期已实现收益 307,838,885.40
2.本期利润 -172,726,638.74
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0512
4.期末基金资产净值 2,915,239,106.60

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 2,596,536,948.82 88.40

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 24,380,000.00 0.84

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 601169 北京银行 3,999,847 202,734,830.13 6.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 1,750,488.12 0.06

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十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 125989 安泰债券 13,614 1,750,488.12 0.06

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五名权证投资明细
5.7 报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明
5.8 本报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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备选股票库之外的股票。
5.9.2 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备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产
5.9.4 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.5 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.6 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.7 影响投资者决策的其他重要信息
5.9.8 备查文件目录
5.9.9 备查文件目录

5.9.10 备查文件目录
5.9.11 备查文件目录
5.9.12 备查文件目录

5.9.13 备查文件目录
5.9.14 备查文件目录
5.9.15 备查文件目录

5.9.16 备查文件目录
5.9.17 备查文件目录
5.9.18 备查文件目录

5.9.19 备查文件目录
5.9.20 备查文件目录
5.9.21 备查文件目录

5.9.22 备查文件目录
5.9.23 备查文件目录
5.9.24 备查文件目录

5.9.25 备查文件目录
5.9.26 备查文件目录
5.9.27 备查文件目录

截至报告期末,本基金份额净值为0.885元,本报告期份额净值增长率为-6.15%,同期业绩比较基准增长率为-3.87%,低于业绩比较基准的表现。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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十名债券投资明细

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五名权证投资明细
5.7 报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明
5.8 本报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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备选股票库之外的股票。
5.9.2 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备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产
5.9.4 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.5 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.6 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.7 影响投资者决策的其他重要信息
5.9.8 备查文件目录
5.9.9 备查文件目录

5.9.10 备查文件目录
5.9.11 备查文件目录
5.9.12 备查文件目录

5.9.13 备查文件目录
5.9.14 备查文件目录
5.9.15 备查文件目录

5.9.16 备查文件目录
5.9.17 备查文件目录
5.9.18 备查文件目录

5.9.19 备查文件目录
5.9.20 备查文件目录
5.9.21 备查文件目录

5.9.22 备查文件目录
5.9.23 备查文件目录
5.9.24 备查文件目录

5.9.25 备查文件目录
5.9.26 备查文件目录
5.9.27 备查文件目录

5.9.28 备查文件目录
5.9.29 备查文件目录
5.9.30 备查文件目录

5.9.31 备查文件目录
5.9.32 备查文件目录
5.9.33 备查文件目录

5.9.34 备查文件目录
5.9.35 备查文件目录
5.9.36 备查文件目录

5.9.37 备查文件目录
5.9.38 备查文件目录
5.9.39 备查文件目录

5.9.40 备查文件目录
5.9.41 备查文件目录
5.9.42 备查文件目录

5.9.43 备查文件目录
5.9.44 备查文件目录
5.9.45 备查文件目录

5.9.46 备查文件目录
5.9.47 备查文件目录
5.9.48 备查文件目录

5.9.49 备查文件目录
5.9.50 备查文件目录
5.9.51 备查文件目录

5.9.52 备查文件目录
5.9.53 备查文件目录
5.9.54 备查文件目录

大成策略回报股票型证券投资基金 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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2009年10月27日

1 重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2 基金产品概况
本基金名称:大成策略回报股票
基金代码:090007
基金运作方式:契约型开放式

3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标
1.本期已实现收益 62,706,320.17
2.本期利润 -31,313,319.27
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0479
4.期末基金资产净值 799,431,080.46

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 715,805,890.66 85.29

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 5,431,105.60 0.68

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 601169 北京银行 1,941,609 33,453,923.07 4.18

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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十名债券投资明细

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五名权证投资明细
5.7 报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明
5.8 本报告期末本基金持有的股指期货投资情况说明

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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备选股票库之外的股票。
5.9.2 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备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产
5.9.4 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.5 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.6 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
5.9.7 影响投资者决策的其他重要信息
5.9.8 备查文件目录
5.9.9 备查文件目录

5.9.10 备查文件目录
5.9.11 备查文件目录
5.9.12 备查文件目录

5.9.13 备查文件目录
5.9.14 备查文件目录
5.9.15 备查文件目录

5.9.16 备查文件目录
5.9.17 备查文件目录
5.9.18 备查文件目录

5.9.19 备查文件目录
5.9.20 备查文件目录
5.9.21 备查文件目录

5.9.22 备查文件目录
5.9.23 备查文件目录
5.9.24 备查文件目录

5.9.25 备查文件目录
5.9.26 备查文件目录
5.9.27 备查文件目录

5.9.28 备查文件目录
5.9.29 备查文件目录
5.9.30 备查文件目录

5.9.31 备查文件目录
5.9.32 备查文件目录
5.9.33 备查文件目录

5.9.34 备查文件目录
5.9.35 备查文件目录
5.9.36 备查文件目录

5.9.37 备查文件目录
5.9.38 备查文件目录
5.9.39 备查文件目录

5.9.40 备查文件目录
5.9.41 备查文件目录
5.9.42 备查文件目录

5.9.43 备查文件目录
5.9.44 备查文件目录
5.9.45 备查文件目录

5.9.46 备查文件目录
5.9.47 备查文件目录
5.9.48 备查文件目录

5.9.49 备查文件目录
5.9.50 备查文件目录
5.9.51 备查文件目录

5.9.52 备查文件目录
5.9.53 备查文件目录
5.9.54 备查文件目录

5.9.55 备查文件目录
5.9.56 备查文件目录
5.9.57 备查文件目录

5.9.58 备查文件目录
5.9.59 备查文件目录
5.9.60 备查文件目录

5.9.61 备查文件目录
5.9.62 备查文件目录
5.9.63 备查文件目录

5.9.64 备查文件目录
5.9.65 备查文件目录
5.9.66 备查文件目录

5.9.67 备查文件目录
5.9.68 备查文件目录
5.9.69 备查文件目录

5.9.70 备查文件目录
5.9.71 备查文件目录
5.9.72 备查文件目录

5.9.73 备查文件目录
5.9.74 备查文件目录
5.9.75 备查文件目录

5.9.76 备查文件目录
5.9.77 备查文件目录
5.9.78 备查文件目录

5.9.79 备查文件目录
5.9.80 备查文件目录
5.9.81 备查文件目录

5.9.82 备查文件目录
5.9.83 备查文件目录
5.9.84 备查文件目录

5.9.85 备查文件目录
5.9.86 备查文件目录
5.9.87 备查文件目录

5.9.88 备查文件目录
5.9.89 备查文件目录
5.9.90 备查文件目录

5.9.91 备查文件目录
5.9.92 备查文件目录
5.9.93 备查文件目录

5.9.94 备查文件目录
5.9.95 备查文件目录
5.9.96 备查文件目录

5.9.97 备查文件目录
5.9.98 备查文件目录
5.9.99 备查文件目录

5.9.100 备查文件目录
5.9.101 备查文件目录
5.9.102 备查文件目录

5.9.103 备查文件目录
5.9.104 备查文件目录
5.9.105 备查文件目录

5.9.106 备查文件目录
5.9.107 备查文件目录
5.9.108 备查文件目录

5.9.109 备查文件目录
5.9.110 备查文件目录
5.9.111 备查文件目录

5.9.112 备查文件目录
5.9.113 备查文件目录
5.9.114 备查文件目录

5.9.115 备查文件目录
5.9.116 备查文件目录
5.9.117 备查文件目录

5.9.118 备查文件目录
5.9.119 备查文件目录
5.9.120 备查文件目录

5.9.121 备查文件目录
5.9.122 备查文件目录
5.9.123 备查文件目录

5.9.124 备查文件目录
5.9.125 备查文件目录
5.9.126 备查文件目录

5.9.127 备查文件目录
5.9.128 备查文件目录
5.9.129 备查文件目录

5.9.130 备查文件目录
5.9.131 备查文件目录
5.9.132 备查文件目录

5.9.133 备查文件目录
5.9.134 备查文件目录
5.9.135 备查文件目录

5.9.136 备查文件目录
5.9.137 备查文件目录
5.9.138 备查文件目录

5.9.139 备查文件目录
5.9.140 备查文件目录
5.9.141 备查文件目录

5.9.142 备查文件目录
5.9.143 备查文件目录
5.9.144 备查文件目录

5.9.145 备查文件目录
5.9.146 备查文件目录
5.9.147 备查文件目录

5.9.148 备查文件目录
5.9.149 备查文件目录
5.9.150 备查文件目录

5.9.151 备查文件目录
5.9.152 备查文件目录
5.9.153 备查文件目录

5.9.154 备查文件目录
5.9.155 备查文件目录
5.9.156 备查文件目录

5.9.157 备查文件目录
5.9.158 备查文件目录
5.9.159 备查文件目录

5.9.160 备查文件目录
5.9.161 备查文件目录
5.9.162 备查文件目录

5.9.163 备查文件目录
5.9.164 备查文件目录
5.9.165 备查文件目录

5.9.166 备查文件目录
5.9.167 备查文件目录
5.9.168 备查文件目录

5.9.169 备查文件目录
5.9.170 备查文件目录
5.9.171 备查文件目录

5.9.172 备查文件目录
5.9.173 备查文件目录
5.9.174 备查文件目录

5.9.175 备查文件目录
5.9.176 备查文件目录
5.9.177 备查文件目录

5.9.178 备查文件目录
5.9.179 备查文件目录
5.9.180 备查文件目录

5.9.181 备查文件目录
5.9.182 备查文件目录
5.9.183 备查文件目录

5.9.184 备查文件目录
5.9.185 备查文件目录
5.9.186 备查文件目录

5.9.187 备查文件目录
5.9.188 备查文件目录
5.9.189 备查文件目录

5.9.190 备查文件目录
5.9.191 备查文件目录
5.9.192 备查文件目录

5.9.193 备查文件目录
5.9.194 备查文件目录
5.9.195 备查文件目录

5.9.196 备查文件目录
5.9.197 备查文件目录
5.9.198 备查文件目录

5.9.199 备查文件目录
5.9.200 备查文件目录
5.9.201 备查文件目录

5.9.202 备查文件目录
5.9.203 备查文件目录
5.9.204 备查文件目录

5.9.205 备查文件目录
5.9.206 备查文件目录
5.9.207 备查文件目录

5.9.208 备查文件目录
5.9.209 备查文件目录
5.9.210 备查文件目录

5.9.211 备查文件目录
5.9.212 备查文件目录
5.9.213 备查文件目录

5.9.214 备查文件目录
5.9.215 备查文件目录
5.9.216 备查文件目录

5.9.217 备查文件目录
5.9.218 备查文件目录
5.9.219 备查文件目录

5.9.220 备查文件目录
5.9.221 备查文件目录
5.9.222 备查文件目录

5.9.223 备查文件目录
5.9.224 备查文件目录
5.9.225 备查文件目录

5.9.226 备查文件目录
5.9.227 备查文件目录
5.9.228 备查文件目录

5.9.229 备查文件目录
5.9.230 备查文件目录
5.9.231 备查文件目录

5.9.232 备查文件目录
5.9.233 备查文件目录
5.9.234 备查文件目录

5.9.235 备查文件目录
5.9.236 备查文件目录
5.9.237 备查文件目录

5.9.238 备查文件目录
5.9.239 备查文件目录
5.9.240 备查文件目录

5.9.241 备查文件目录
5.9.242 备查文件目录
5.9.243 备查文件目录

5.9.244 备查文件目录
5.9.245 备查文件目录
5.9.246 备查文件目录

5.9.247 备查文件目录
5.9.248 备查文件目录
5.9.249 备查文件目录

5.9.250 备查文件目录
5.9.251 备查文件目录
5.9.252 备查文件目录

5.9.253 备查文件目录
5.9.254 备查文件目录
5.9.255 备查文件目录

5.9.256 备查文件目录
5.9.257 备查文件目录
5.9.258 备查文件目录