

大成沪深300指数证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成沪深300指数
交易代码:519000
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年04月06日
报告期末基金份额总额:6,436,407,974.83份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

基金也将或受其他因素影响,过度交易或投资失误已带来了较高的通胀预期,并且相关的资产价格也在被通胀预期而带来的通胀预期所驱动,因此也将对基金的投资业绩产生影响。

本基金将保持积极主动的投资理念,继续深入研究更加有效的交易策略,风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对通胀,积极应对其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在最低的水平,努力做好对投资者的服务。

85 投资组合报告

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets). Rows include 1.权益投资, 2.其中:股票, 3.固定收益投资, 4.其中:债券, 5.买入返售金融资产, 6.其中:买断式回购的买入返售金融资产, 7.其他资产, 8.合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A.农林、牧、渔, B.采掘业, C.制造业, C1.食品、饮料, C2.纺织、服装、皮毛, C3.造纸、印刷, C4.石化、化学、塑胶、塑料, C5.电子, C6.金属、非金属, C7.机械、设备、仪表, C8.医药、生物制品, C9.其他制造业, D.电力、煤气及水的生产和供应业, E.建筑业, F.交通运输、仓储业, G.信息技术业, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化产业, M.综合类, 合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 600936 招商银行, 2. 601328 交通银行, 3. 601318 民生银行, 4. 600016 民生银行, 5. 600039 中信证券, 6. 601166 兴业银行, 7. 600000 浦发银行, 8. 601088 中国神华, 9. 000002 万科A, 10. 601169 北京银行.

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 摊余成本, 8. 其他, 9. 合计.

5.8.4 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。

5.8.5 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不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四至五人原因,分项之和与合计可能有尾差。

86 开放式基金资产变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 单位:份 (Unit: Shares). Rows include 报告期期初基金份额总额, 报告期基金申购份额, 报告期基金赎回份额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, 报告期基金份额总额.

87 影响投资者决策的其他重要信息

无。

88 备查文件目录

- 1. 中国证监会关于核准大成沪深300指数证券投资基金募集的批复;
2. 大成沪深300指数证券投资基金基金合同;
3. 大成沪深300指数证券投资基金托管协议;
4. 大成基金资产管理人注册文件、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。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

大成积极成长股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成积极成长股票
交易代码:519017
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年1月16日
报告期末基金份额总额:3,061,325,526.68份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

基金也将或受其他因素影响,过度交易或投资失误已带来了较高的通胀预期,并且相关的资产价格也在被通胀预期而带来的通胀预期所驱动,因此也将对基金的投资业绩产生影响。

本基金将保持积极主动的投资理念,继续深入研究更加有效的交易策略,风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对通胀,积极应对其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在最低的水平,努力做好对投资者的服务。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A.农林、牧、渔, B.采掘业, C.制造业, C1.食品、饮料, C2.纺织、服装、皮毛, C3.造纸、印刷, C4.石化、化学、塑胶、塑料, C5.电子, C6.金属、非金属, C7.机械、设备、仪表, C8.医药、生物制品, C9.其他制造业, D.电力、煤气及水的生产和供应业, E.建筑业, F.交通运输、仓储业, G.信息技术业, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化产业, M.综合类, 合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1. 600036 招商银行, 2. 601318 中国平安, 3. 002024 苏宁电器, 4. 600568 泸州老窖, 5. 000538 云南白药, 6. 600519 贵州茅台, 7. 000848 承德露露, 8. 600267 海正药业, 9. 600887 *ST伊利, 10. 000423 东阿阿胶.

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 摊余成本, 8. 其他, 9. 合计.

5.8.4 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。

5.8.5 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未存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四至五人原因,分项之和与合计可能有尾差。

86 开放式基金资产变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 单位:份 (Unit: Shares). Rows include 报告期期初基金份额总额, 报告期基金申购份额, 报告期基金赎回份额, 报告期基金总申购份额, 报告期基金总赎回份额, 报告期基金份额总额.

87 影响投资者决策的其他重要信息

无。

88 备查文件目录

- 1. 中国证监会核准设立大成积极成长股票型证券投资基金的文件;
2. 大成积极成长股票型证券投资基金基金合同;
3. 大成积极成长股票型证券投资基金托管协议;
4. 大成基金资产管理人注册文件、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。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成精选增值混合
交易代码:090004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年12月15日
报告期末基金份额总额:3,474,296,028.80份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

大成精选增值混合型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成精选增值混合
交易代码:090004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年12月15日
报告期末基金份额总额:3,474,296,028.80份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

基金也将或受其他因素影响,过度交易或投资失误已带来了较高的通胀预期,并且相关的资产价格也在被通胀预期而带来的通胀预期所驱动,因此也将对基金的投资业绩产生影响。

本基金将保持积极主动的投资理念,继续深入研究更加有效的交易策略,风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对通胀,积极应对其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在最低的水平,努力做好对投资者的服务。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

大成精选增值混合型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成精选增值混合
交易代码:090004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年12月15日
报告期末基金份额总额:3,474,296,028.80份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

基金也将或受其他因素影响,过度交易或投资失误已带来了较高的通胀预期,并且相关的资产价格也在被通胀预期而带来的通胀预期所驱动,因此也将对基金的投资业绩产生影响。

本基金将保持积极主动的投资理念,继续深入研究更加有效的交易策略,风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对通胀,积极应对其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在最低的水平,努力做好对投资者的服务。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

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

重要提示

基金管理人及基金托管人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大成基金合同约定,于2010年1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,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,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。
本报告日期 2009年10月1日起至2009年12月31日止

82 基金产品概况

基金简称:大成精选增值混合
交易代码:090004
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年12月15日
报告期末基金份额总额:3,474,296,028.80份

83 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期(2009年10月1日至2009年12月31日) (Reporting Period). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Stage), 净值增长① (Net Value Growth 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益③ (Benchmark Return 3), 业绩比较基准收益标准差④ (Benchmark Return Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4).

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

图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。

基金也将或受其他因素影响,过度交易或投资失误已带来了较高的通胀预期,并且相关的资产价格也在被通胀预期而带来的通胀预期所驱动,因此也将对基金的投资业绩产生影响。

本基金将保持积极主动的投资理念,继续深入研究更加有效的交易策略,风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对通胀,积极应对其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在最低的水平,努力做好对投资者的服务。

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

大成基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日