

大成价值增长证券投资基金 2010 第三季度报告

2010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

重要提示:基金管理人及基金托管人按照法律法规规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性...

基金概况:基金名称:大成价值增长混合;基金代码:090001;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日:2002年11月11日

投资目标:以价值增长类资产为主构建投资组合,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和投资组合的动态调整,达到超越市场的风险收益比目标...

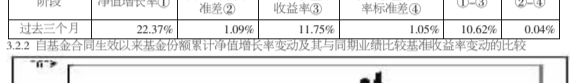
业绩比较基准:沪深300指数*80%+中信标普国债指数*20%

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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



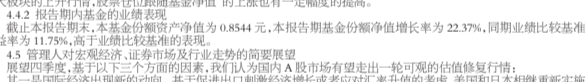
注:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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



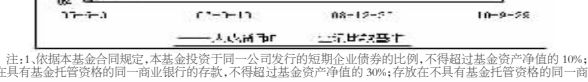
注:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:12.97728388978;报告期末基金份额持有人户数:85844

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-367,178,083.04;本期利润:2,322,485,718.57

基金净值表现:过去三个月净值增长率:22.37%;同期业绩比较基准收益率:10.95%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

均衡化行业配置,增持估值合理的保险、汽车和煤炭、通信、医药等行业个股,在严格控制风险的前提下,适度挖掘“和合”有色等周期性行业的投资机会

5.1 报告期末基金资产组合情况:权益投资 9,579,902,721.72;其中:股票 9,579,902,721.72;债券 2,506,238,092.30

5.2 报告期末前十名股票投资明细:宝钢股份 3,022,093.13;中信证券 4,707,739,524.20;招商银行 8,687,686,207.87

5.3 报告期末前十名债券投资明细:090001 17,500,000;090023 10,000,000;090028 11,480,995

5.4 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:宝钢股份 858,091,092.30;民生银行 892,746,000.00;招商银行 755,401,000.00

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:011020 02国债03 3,384,610;011012 21国债02 2,464,900;010110 21国债01 2,104,840

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权证投资明细:无

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:无

5.8 投资组合报告附注:无

5.8.1 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、处罚的情况

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

5.8.3 其他资产构成:银行存款 6,647,014.52;应收利息 163,994,122.78;应收股利 38,485,322.28

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细:无

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明:无

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分:无

5.9 开放式基金份额变动:期初 14,984,196,138.67;申购 82,986,827.96;赎回 -881,169,151.40

5.10 影响投资者决策的其他重要信息:无

5.11 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

5.12 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

5.13 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

5.14 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

5.15 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

5.16 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

5.17 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

5.18 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

5.19 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

5.20 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

5.21 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

5.22 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

5.23 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

5.24 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

5.25 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

5.26 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

5.27 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

5.28 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

5.29 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

5.30 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

5.31 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

5.32 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

5.33 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

大成沪深300指数证券投资基金 2010 第三季度报告

2010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

重要提示:基金管理人及基金托管人按照法律法规规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性...

基金概况:基金名称:大成沪深300指数;基金代码:519100;基金运作方式:契约型开放式;基金合同生效日:2006年4月6日

投资目标:通过严格的资产组合约束和数量化风险管理手段,实现指数投资跟踪标的指数的跟踪误差最小化...

业绩比较基准:沪深300指数

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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



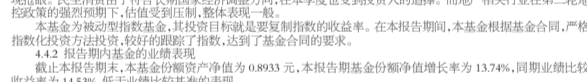
注:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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



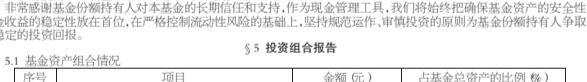
注:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

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

主要财务指标:报告期末基金份额净值:9.75088505905;报告期末基金份额持有人户数:8710,046,741.24

主要财务指标:报告期(2010年7月1日至2010年9月30日)本期已实现收益:-59,625,282.05;本期利润:973,682,625.52

基金净值表现:过去三个月净值增长率:13.74%;同期业绩比较基准收益率:14.51%;自基金合同生效以来基金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:1.本基金合同约定,本基金的定期建仓期为6个月。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已达到基金合同中规定的内容...

未来平滑增长预期的改变,将会使得投资者对前期部分低估的行业重新认识,存在估值修复的机会

5.1 报告期末基金资产组合情况:权益投资 8,219,796,900.85;其中:股票 8,219,796,900.85

5.2 报告期末前十名股票投资明细:宝钢股份 3,206,930.22;民生银行 930,414,795.00;招商银行 2,776,046,869.11

5.3 报告期末前十名债券投资明细:090001 17,500,000;090023 10,000,000;090028 11,480,995

5.4 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:宝钢股份 858,091,092.30;民生银行 892,746,000.00;招商银行 755,401,000.00

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:011020 02国债03 3,384,610;011012 21国债02 2,464,900;010110 21国债01 2,104,840

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:无

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:无

5.8 投资组合报告附注:无

5.8.1 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、处罚的情况

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

5.8.3 其他资产构成:银行存款 6,647,014.52;应收利息 163,994,122.78;应收股利 38,485,322.28

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细:无

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明:无

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分:无

5.9 开放式基金份额变动:期初 8,705,965,920.19;申购 82,986,827.96;赎回 -881,169,151.40

5.10 影响投资者决策的其他重要信息:无

5.11 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

5.12 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

5.13 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

5.14 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

5.15 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

5.16 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

5.17 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

5.18 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

5.19 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

5.20 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

5.21 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

5.22 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

5.23 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

5.24 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

5.25 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

5.26 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

5.27 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

5.28 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

5.29 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

5.30 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

5.31 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

5.32 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

5.33 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