

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

大成精选增值混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

重要提示
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,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告财务资料未经审计。

本报告自2011年7月1日起生效并适用。
本报告期内2011年7月1日至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金名称, 大成精选增值混合型证券投资基金; 基金简称, 大成精选增值混合; 基金代码, 090004; 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; 基金合同生效日, 2004年12月15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; 截至本报告期末前10名基金份额持有人, 3,157,911,373.70份; 基金合同生效日, 2004年12月15日

2.2 基金产品说明
投资目标: 本基金具有追求价值投资趋势和长期增值潜力的行业和个股,为投资者寻求持续稳定的投资收益。
投资策略: 本基金利用大成基金自行开发的投资管理流程,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优势和价值和长期增值潜力的行业和个股,通过积极主动的投资策略,追求基金资产长期的资本增值。

业绩比较基准: 沪深300指数x75%+中国债券指数x25%
风险收益特征: 本基金属混合型证券投资基金,由于本基金采取积极的投资管理,主动的资产配置,使得本基金为证券投资基金中风险程度中等偏高的基金品种,其长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金,指数型基金,纯股票基金,纯债券基金和货币基金。

Table with 2 columns: 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; 名称, 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; 信息披露负责人, 姓名: 杜娟, 职务: 李芳菲; 联系电话: 0755-83183388, 010-66000069; 电子邮箱: dafeng@dfund.com.cn, jiangf@dfund.com.cn; 客户服务电话: 4008855588, 95599; 传真: 0755-83199588, 010-63201816

2.4 信息披露方式
投资者可通过基金管理人网站访问: http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点: 深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限责任公司; 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

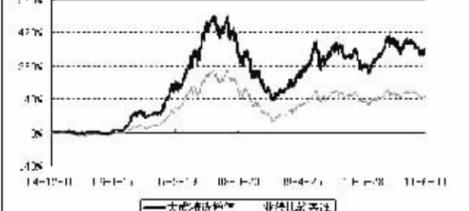
3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 项目, 本期(2011年1月1日至2011年6月30日); 上期(2010年1月1日至2010年6月30日); 本期已实现收益, 91,551,643.18; 本期利润, -123,020,553.74; 加权平均基金份额本期利润, -0.0431; 本期基金份额净值增长率, -4.70%; 3.1.2 期末数据和指标, 报告期末(2011年6月30日); 期末可供分配基金份额利润, 0.4728; 期末基金资产净值, 3,137,324,798.88; 期末基金份额净值, 0.9935

注: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。2.所述基金净值增长率不包括持有认购及申购款项的各项费用,计入费用后净值增长率低于下列数据。

Table with 2 columns: 期间, 报告期末(2011年6月30日); 上期(2010年6月30日); 过去一个月, 4.88%, 1.19%, 0.96%, 0.96%, 3.90%, 0.29%; 过去三个月, -4.57%, 1.08%, -4.08%, 0.33%, -0.48%, 0.25%; 过去六个月, -4.70%, 1.23%, -1.61%, 0.33%, -1.09%, 0.30%; 过去一年, 27.66%, 1.35%, 16.91%, 1.04%, 10.73%, 0.31%; 过去三年, 35.99%, 1.67%, 18.52%, 1.50%, 17.47%, 0.17%; 自基金合同生效起至今, 355.59%, 1.71%, 154.73%, 1.50%, 200.62%, 0.21%

3.2 基金业绩比较基准



注:1.本基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的比例。

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合同》的约定,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4000指数x75%+新华富时中国国债指数x25%”变更为“沪深300指数x75%+中国债券指数x25%”。

4.1 基金管理人及基金基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
大成基金管理有限公司经中国证监会基金字[1999]30号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地址为北京。目前公司由国资委控股,是中国中泰证券投资有限公司(88%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、光大证券股份有限公司(2%)、截至2011年6月30日,大成基金管理有限公司共管理13只封闭式证券投资基金:景顺长城证券投资基金、大成优选证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成策略回报证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成创新成长证券投资基金、大成积极成长证券投资基金、大成行业轮动证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票证券投资基金、大成保本混合证券投资基金和大成内源回报股票证券投资基金。

4.1.2 基金业绩
截至本报告期末,大成精选增值混合型证券投资基金自2011年1月1日至2011年6月30日止,基金份额净值为0.9935元,基金份额总额为3,157,911,373.70份。

4.2 基金经理

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期; 姓名: 刘亚娟, 职务: 基金经理, 任职日期: 2010年4月7日, 离任日期: 7年; 姓名: 杜娟, 职务: 基金经理, 任职日期: 2010年4月7日, 离任日期: 7年; 姓名: 李芳菲, 职务: 基金经理, 任职日期: 2010年4月7日, 离任日期: 7年

1. 任职日期、离任日期为基金管理人作出决定之日。
2. 基金经理的任职标准遵循中国证监会《证券投资基金管理行业从业人员资格管理规定》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金合同》及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,投资运作规范,基金管理人及基金资产未发生任何违法违规行为,也未发生任何有损基金份额持有人利益的行为,基金管理人及基金资产未发生任何违法违规行为,也未发生任何有损基金份额持有人利益的行为,基金管理人及基金资产未发生任何违法违规行为,也未发生任何有损基金份额持有人利益的行为。

4.3 关联交易
本报告期内,本基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.4 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.5 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.6 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.7 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.8 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.9 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.10 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.11 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.12 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.13 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.14 基金管理人及基金托管人未发生任何关联交易。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金管理人严格按照基金合同约定的规定进行收益分配。本报告期末本基金可供分配收益为1,492,996,638.03元,本基金已于2011年1月17日公告以截至2010年12月31日可供分配收益为基准,向基金份额持有人进行收益分配,每10份基金份额派发现金红利0.13元,符合基金合同约定的分配比例。

4.8 托管人
4.8.1 报告期内本基金托管人履职情况说明
在管理大成精选增值混合型证券投资基金的过程中,基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成精选增值混合型证券投资基金合同》、《大成精选增值混合型证券投资基金托管协议》的约定,对大成精选增值混合型证券投资基金管理人——大成基金管理有限公司2011年1月1日至2011年6月30日基金的投资行为,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.8.2 托管人对报告期内本基金投资遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为,大成基金管理有限公司在大成精选增值混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、利润分配等事宜上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同约定进行。

4.8.3 托管人对半年度报告中基金净值信息的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为,大成基金管理有限公司信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的大成精选增值混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关基金资产运作的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4.9 关联方
4.9.1 关联方
4.9.2 关联方
4.9.3 关联方

4.9.4 关联方
4.9.5 关联方
4.9.6 关联方

4.9.7 关联方
4.9.8 关联方
4.9.9 关联方

4.9.10 关联方
4.9.11 关联方
4.9.12 关联方

4.9.13 关联方
4.9.14 关联方
4.9.15 关联方

4.9.16 关联方
4.9.17 关联方
4.9.18 关联方

4.9.19 关联方
4.9.20 关联方
4.9.21 关联方

4.9.22 关联方
4.9.23 关联方
4.9.24 关联方

4.9.25 关联方
4.9.26 关联方
4.9.27 关联方

4.9.28 关联方
4.9.29 关联方
4.9.30 关联方

4.9.31 关联方
4.9.32 关联方
4.9.33 关联方

4.9.34 关联方
4.9.35 关联方
4.9.36 关联方

4.9.37 关联方
4.9.38 关联方
4.9.39 关联方

4.9.40 关联方
4.9.41 关联方
4.9.42 关联方

4.9.43 关联方
4.9.44 关联方
4.9.45 关联方

4.9.46 关联方
4.9.47 关联方
4.9.48 关联方

4.9.49 关联方
4.9.50 关联方
4.9.51 关联方

4.9.52 关联方
4.9.53 关联方
4.9.54 关联方

4.9.55 关联方
4.9.56 关联方
4.9.57 关联方

4.9.58 关联方
4.9.59 关联方
4.9.60 关联方

4.9.61 关联方
4.9.62 关联方
4.9.63 关联方

4.9.64 关联方
4.9.65 关联方
4.9.66 关联方

4.9.67 关联方
4.9.68 关联方
4.9.69 关联方

4.9.70 关联方
4.9.71 关联方
4.9.72 关联方

4.9.73 关联方
4.9.74 关联方
4.9.75 关联方

4.9.76 关联方
4.9.77 关联方
4.9.78 关联方

4.9.79 关联方
4.9.80 关联方
4.9.81 关联方

4.9.82 关联方
4.9.83 关联方
4.9.84 关联方

4.9.85 关联方
4.9.86 关联方
4.9.87 关联方

4.9.88 关联方
4.9.89 关联方
4.9.90 关联方

4.9.91 关联方
4.9.92 关联方
4.9.93 关联方

4.9.94 关联方
4.9.95 关联方
4.9.96 关联方

4.9.97 关联方
4.9.98 关联方
4.9.99 关联方

4.9.100 关联方
4.9.101 关联方
4.9.102 关联方

4.9.103 关联方
4.9.104 关联方
4.9.105 关联方

4.9.106 关联方
4.9.107 关联方
4.9.108 关联方

4.9.109 关联方
4.9.110 关联方
4.9.111 关联方

4.9.112 关联方
4.9.113 关联方
4.9.114 关联方

4.9.115 关联方
4.9.116 关联方
4.9.117 关联方

5.1 投资组合
5.1.1 资产配置
5.1.2 行业配置
5.1.3 个股配置

5.2 流动性
5.2.1 流动性
5.2.2 流动性

5.3 风险管理
5.3.1 风险管理
5.3.2 风险管理

5.4 合规
5.4.1 合规
5.4.2 合规

5.5 其他
5.5.1 其他
5.5.2 其他

5.6 其他
5.6.1 其他
5.6.2 其他

5.7 其他
5.7.1 其他
5.7.2 其他

5.8 其他
5.8.1 其他
5.8.2 其他

5.9 其他
5.9.1 其他
5.9.2 其他

5.10 其他
5.10.1 其他
5.10.2 其他

5.11 其他
5.11.1 其他
5.11.2 其他

5.12 其他
5.12.1 其他
5.12.2 其他

5.13 其他
5.13.1 其他
5.13.2 其他

5.14 其他
5.14.1 其他
5.14.2 其他

5.15 其他
5.15.1 其他
5.15.2 其他

5.16 其他
5.16.1 其他
5.16.2 其他

5.17 其他
5.17.1 其他
5.17.2 其他

5.18 其他
5.18.1 其他
5.18.2 其他

5.19 其他
5.19.1 其他
5.19.2 其他

5.20 其他
5.20.1 其他
5.20.2 其他

5.21 其他
5.21.1 其他
5.21.2 其他

5.22 其他
5.22.1 其他
5.22.2 其他

5.23 其他
5.23.1 其他
5.23.2 其他

5.24 其他
5.24.1 其他
5.24.2 其他

5.25 其他
5.25.1 其他
5.25.2 其他

5.26 其他
5.26.1 其他
5.26.2 其他

5.27 其他
5.27.1 其他
5.27.2 其他

5.28 其他
5.28.1 其他
5.28.2 其他

5.29 其他
5.29.1 其他
5.29.2 其他

5.30 其他
5.30.1 其他
5.30.2 其他

5.31 其他
5.31.1 其他
5.31.2 其他

5.32 其他
5.32.1 其他
5.32.2 其他

5.33 其他
5.33.1 其他
5.33.2 其他

5.34 其他
5.34.1 其他
5.34.2 其他

5.35 其他
5.35.1 其他
5.35.2 其他

5.36 其他
5.36.1 其他
5.36.2 其他

5.37 其他
5.37.1 其他
5.37.2 其他

5.38 其他
5.38.1 其他
5.38.2 其他

5.39 其他
5.39.1 其他
5.39.2 其他

5.40 其他
5.40.1 其他
5.40.2 其他

5.41 其他
5.41.1 其他
5.41.2 其他

5.42 其他
5.42.1 其他
5.42.2 其他

5.43 其他
5.43.1 其他
5.43.2 其他

注:本期累计卖出金额扣除卖出成交金额(成交净额以成交数量),不考虑相关交易费用。

Table with 2 columns: 基金名称, 大成精选增值混合型证券投资基金; 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; 基金合同生效日, 2004年12月15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; 截至本报告期末前10名基金份额持有人, 3,157,911,373.70份; 基金合同生效日, 2004年12月15日

注:1.上述金额均指成交金额(成交净额以成交数量),不考虑相关交易费用。
2. 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 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

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

7.8 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

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内基金投资的十只证券的发行主体无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。

7.9.2 本基金投资前十名股票中,没有出现投资于超出基金合同规定的备选股票之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.6 投资组合报告附注

7.9.7 投资组合报告附注

7.9.8 投资组合报告附注

7.9.9 投资组合报告附注

7.9.10 投资组合报告附注

7.9.11 投资组合报告附注

7.9.12 投资组合报告附注

7.9.13 投资组合报告附注

7.9.14 投资组合报告附注

7.9.15 投资组合报告附注

7.9.16 投资组合报告附注

7.9.17 投资组合报告附注

7.9.18 投资组合报告附注

7.9.19 投资组合报告附注

7.9.20 投资组合报告附注

7.9.21 投资组合报告附注

7.9.22 投资组合报告附注

7.9.23 投资组合报告附注

7.9.24 投资组合报告附注

7.9.25 投资组合报告附注

7.9.26 投资组合报告附注

7.9.27 投资组合报告附注

7.9.28 投资组合报告附注

7.9.29 投资组合报告附注

7.9.30 投资组合报告附注

7.9.31 投资组合报告附注

7.9.32 投资组合报告附注

7.9.33 投资组合报告附注

7.9.34 投资组合报告附注