

信息披露

大成精选增值混合型证券投资基金

2008年12月31日

2008年度报告摘要

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

送出日期:2009年3月31日

§ 1 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，并对其实质内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签字。

大成基金管理有限公司(以下简称“大成农业银行”)根据本基金合同规定，于2009年3月25日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 2 基金简介

基金简称	大成精选增值
交易代码	090004
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2004年12月15日
报告期末基金份额总额	3,505,175,374.21份

§ 2.2 基金产品说明

投资目标	投资具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业，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，自下而上精选个股的投资策略，主要投资于具有竞争优势和长期增值潜力的行业和企业。本基金长期投资的资产配置比例在股票类资产、债券类资产、现金类资产之间进行调整，以保持其持续适应当市情况。本基金投资的股票类资产比例在股票类资产、债券类资产、现金类资产之间进行调整，以保持其持续适应当市情况。

§ 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行
姓名	杜鹏	李芳菲
信息披露负责人	0755-83183388 电子邮箱:dupeng@dfund.com.cn	010-68435588 电子邮箱:hifangfei@abchina.com
客户服务电话	400-888-5558	95599
传真	0755-83199588	010-68424181

§ 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.dfund.com.cn
基金年度报告置地	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公司 北京市海淀区西北二环路100号金玉大厦 中国农业银行托管业务部
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	

单位:人民币元

§ 3.1.1 期间数据和指标

2008年 2007年 2006年

本期实现收益 -1,534,371,184.18 6,082,454,799.92 151,128,422.78

-3,048,284,666.06 7,125,582,931.98 551,031,846.14

-0.8592 1,2103 1,2355

本期基金份额本期利润 -52.50% 124.66% 150.55%

本期基金份额净值增长率 -52.50% 124.66% 150.55%

3.1.2 期间数据和指标

2008年 2007年 2006年

期末可供分配基金份额利润 0.1208 1,2187 0.2930

期末基金资产净值 2,448,587,740.60 6,946,468,135.17 9,442,424,716.55

期末基金份额净值 2.0156 1.0337

注:1.本基金管理人已实现收益指基金本期利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额,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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长 率① 增长率标 准② 业绩比较基 准③ 业绩比较基准准 率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.85% 1.67% -11.01% 2.26% 4.16% -0.59%

过去六个月 -20.31% 1.78% -24.76% 2.23% 4.45% -0.45%

过去一年 -52.50% 2.13% -52.51% 2.28% 0.01% -0.15%

过去三年 167.36% 1.96% 77.57% 1.78% 89.79% 0.18%

自基金合同生 166.84% 1.75% 61.71% 1.62% 105.13% 0.13%

效起至今 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变 动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6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比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:2004年度数据按自基金合同生效日2004年12月15日至2004年12月31日实际期间计算,并未将当年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介

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[2009]10号文批准,于2009年4月12日正式成立,是中证监批准的第10家基金公司,注册资本1亿元人民币,注册地址为北京市朝阳区来广营西路16号院12号大成保险大厦12层。

公司由四家股东组成,分别为大成保险有限公司(25%)、光大证券股份有限公司(25%)、广东证券管理人共(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2008年12月31日,本基金管理人共31只开放式证券投资基金、1只封闭式证券投资基金、大成优债债券型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成景阳增强混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成景阳300指数证券投资基金、大成景阳债券型证券投资基金、大成景阳股票型证券投资基金、大成景阳增强收益型证券投资基金、大成景阳混合型证券投资基金、大成景阳股票型证券投资基金、大成景阳债券型证券投资基金、大成景阳混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名 职务 任职基金的基金期限 证券从业年限 说明

钱辉先生 基金经理 2007年6月27日 13年 士,美国特许金融分析师(CFA),曾任美国摩根大通兄弟公司、美国再保险有限公司、美国Barra投资咨询公司,2004年6月加入大成基金管理有限公司,曾任大成基金管理有限公司投资总监,2006年1月加入大成基金管理有限公司,现任基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国。

张益凡先生 基金经理 2008年12月16日 8年 北京大学光华管理学院硕士,曾任浙江省国际信托投资公司投资部经理,2007年1月加入大成基金管理有限公司,任基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国。

孙蔚琳女士 基金经理助理 2007年12月27日 5年 中国科技大学金融系学士,2007年1月加入大成基金管理有限公司,任基金经理,具有基金从业资格,国籍:中国。

注:1.任职日期、离任日期为本基金经理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2009年1月1日起大成基金管理有限公司经中国证监会批准,同意张益凡先生因个人原因向大成精选增值型基金辞职,由孙蔚琳女士接任基金经理,孙蔚琳女士接任基金经理,具有基金从业资格。

4.2 基金经理对报告期内本基金运作情况的说明

本基金报告期内严格执行《证券投资基金法》、《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理人的指导下,大成精选增值型基金的投资组合、行业配置策略和基金合同约定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有进行有损基金份额持有人利益的关联交易,整体运作合法合规。本基金将始终以维护基金份额持有人利益为最高原则,严格执行基金合同,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金严格按照《证券投资基金法》和《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》,公平对待旗下各投资组合,所管理的各投资组合的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日、同月、10日内)同向、反向交易的交易量和频率均未发现异常。

4.4 投资决策与其他投资风格相同的基金的投资比例

根据基金合同,目前本基金管理人员未有与本基金风格相似的其他基金。

4.5 基金经理对报告期内本基金运作的公平性及利益冲突的说明

本基金报告期内不存在不公平交易和利益冲突的异常交易行为。

4.6 基金经理对报告期内基金投资组合的偏离度的说明

2008年1月1日起至2008年12月31日,本基金的偏离度始终在-0.52%~0.52%之间,期间偏离度始终在-0.52%~0.52%之间,期间偏离度始终在-0.52%~0.52%之间。

5.过去几年的经济增长情况

过去几年的经济增长情况,最近几年的经济增长情况,最近几年的经济增长情况。

6.过去几年的宏观经济情况

过去几年的宏观经济情况,最近几年的宏观经济情况。

7.过去几年的行业情况

过去几年的行业情况,最近几年的行业情况。

8.过去几年的利率情况

过去几年的利率情况,最近几年的利率情况。

9.过去几年的政策情况

过去几年的政策情况,最近几年的政策情况。

10.过去几年的市场情况

过去几年的市场情况,最近几年的市场情况。

11.过去几年的估值情况

过去几年的估值情况,最近几年的估值情况。

12.过去几年的分红情况

过去几年的分红情况,最近几年的分红情况。

13.过去几年的费用情况

过去几年的费用情况,最近几年的费用情况。

14.过去几年的净值情况

过去几年的净值情况,最近几年的净值情况。

15.过去几年的规模情况

过去几年的规模情况,最近几年的规模情况。

16.过去几年的流动性情况

过去几年的流动性情况,最近几年的流动性情况。

17.过去几年的分红情况

过去几年的分红情况,最近几年的分红情况。

18.过去几年的费用情况

过去几年的费用情况,最近几年的费用情况。

19.过去几年的净值情况

过去几年的净值情况,最近几年的净值情况。

20.过去几年的规模情况

过去几年的规模情况,最近几年的规模情况。

21.过去几年的流动性情况

过去几年的流动性情况,最近几年的流动性情况。

22.过去几年的分红情况

过去几年的分红情况,最近几年的分红情况。

23.过去几年的费用情况

过去几年的费用情况,最近几年的费用情况。

24.过去几年的净值情况

过去几年的净值情况,最近几年的净值情况。

25.过去几年的规模情况

过去几年的规模情况,最近几年的规模情况。

26.过去几年的流动性情况

过去几年的流动性情况,最近几年的流动性情况。

27.过去几年的分红情况

过去几年的分红情况,最近几年的分红情况。

28.过去几年的费用情况

过去几年的费用情况,最近几年的费用情况。

29.过去几年的净值情况

过去几年的净值情况,最近几年的净值情况。

30.过去几年的规模情况

过去几年的规模情况,最近几年的规模情况。

31.过去几年的流动性情况

过去几年的流动性情况,最近几年的流动性情况。

32.过去几年的分红情况

过去几年的分红情况,最近几年的分红情况。

33.过去几年的费用情况