

大成精选增值混合型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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

报告送出日期:2012年4月21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本基金合同规定，于2012年4月19日复核了本报告中的基金资产净值及基金收益分配等数据，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的财务状况、净值表现和投资组合等情况，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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 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 约型开放式

基金合同生效日 2004年12月15日

报告期末基金份额总额 2,613,356,437.16份

投资目标 投资于具有竞争力的相对优势和长期增值潜力的行业和企业，为投资者寻求稳定的资本增值。

本基金通过在行业和企业中的投资选择，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，精选股票的投资标的，主要投资于具有竞争力的相对优势和长期增值潜力的行业和企业的股票，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×75%+中证债券指数×25%

风险收益特征 本基金为混合型基金，由本基金采取积极的投资策略，主要投资于具有竞争力的相对优势和长期增值潜力的行业和企业的股票，通过积极主动的投资策略，追求基金资产长期的资本增值。

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

§ 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 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期实现收益 -30,408,766.48

2.本期利润 56,334,508.37

3.加权平均基金份额本期利润 0.0215

4.期末基金份额净值 1,977,362,679.72

5.期末基金份额净值 0.7566

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，本期利润指本期利息收入、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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期利润。

2.所述基金份额指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 1.45% 3.71% 1.14% -0.83% 0.31%

3.2 本基金自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

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.88% 1.45% 3.71% 1.14% -0.83% 0.31%

4.1 管理人报告

4.1.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

刘安田先生 经理 2010年4月7日 8年 金融学硕士，曾长期就职于中国证券投资基金业协会秘书处，现就职于大成基金管理有限公司，工银瑞信基金管理有限公司，现就职于大成基金管理有限公司，金融工程硕士，2008年加入大成基金管理有限公司，担任大成基金管理有限公司研究部总监助理。2010年4月7日起担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，2012年3月20日起担任大成新锐产业股票型证券投资基金基金经理。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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，在基金管理运作上，大成精选增值混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定。本基金报告期内未发生重大违法违规行为，没有违反基金合同规定、损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 本报告期内基金的业绩表现

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》，并经公司监察稽核部定期对公开所有投资组合间公平交易执行情况进行分析。2012年一季度，大成精选增值混合型证券投资基金的投资组合之间公平交易执行情况符合公司制度规定，不存在不公平交易行为。大成精选增值混合型证券投资基金的投资组合之间公平交易执行情况符合公司制度规定，不存在不公平交易行为。

4.3.2 公平交易行为的专项说明

本基金报告期内不存在不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的公平交易专项说明

4.4.1 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.2 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.3 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.4 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.5 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.6 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.7 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.8 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.9 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.10 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.11 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.12 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.13 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.14 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.15 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.16 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.17 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.18 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.19 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.20 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.21 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.22 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.23 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.24 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.25 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.26 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.27 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.28 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.29 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.30 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.31 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.32 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.33 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.34 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.35 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.36 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.37 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.38 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.39 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.40 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.41 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.42 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.43 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.44 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.45 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.46 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.47 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.48 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.49 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.50 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.51 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.52 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.53 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.54 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.55 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.56 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.57 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.58 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.59 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.60 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.61 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.62 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.63 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.64 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.65 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.66 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.67 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.68 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.69 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.70 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.71 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.72 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.73 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.74 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.75 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.76 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.77 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.78 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.79 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.80 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.81 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.82 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.83 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.84 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.85 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.86 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.87 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.88 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.89 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.90 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.91 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.92 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.93 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.94 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.95 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.96 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.97 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.98 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.99 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.100 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.101 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.102 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.103 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.104 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.105 报告期内本基金未进行过不公平交易。

4.4.106 报告期内本基金未进行过不公平交易。