

Disclosure

§1 重要提示

基金管理人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2009年4月16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，基金的投资业绩并不预示其未来表现。投资者有风险，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。
本财务报告财务数据未经审计。
本报告日期自2009年1月1日起至2009年3月31日止。

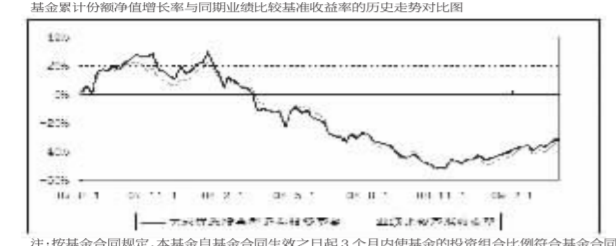
§2 基金产品概况

基金简称:	大成优选股票
交易代码:	160402
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2008年8月1日
报告期末基金份额总额:	1,407,000,709.09份
投资策略:	在符合基金合同的前提下，本基金将在股票市场上，根据对宏观经济、行业、公司基本面分析，主要采用自上而下的主动投资策略，获取超额收益。投资组合比例调整、资产配置调整、风险控制过程、分散资产配置并追求超额收益。
业绩比较基准:	80%×沪深300指数+20%×中债国债综合指数
风险收益特征:	本基金属股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金和债券型基金，属于较高风险投资品种。
基金管理人:	大成基金管理有限公司
基金托管人:	中国银行股份有限公司

§3 主要财务数据和净值表现

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期实现收益	-216,726,647.27
2.本期基金份额持有人损益	590,589,187.47
3.期末可供分配基金份额	1,260,000,000.00
4.期末可供分配利润	3,076,974,406.27
5.期末基金份额净值	2.18
6.期末基金份额持有人户数	6,068

注:1、本期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。本期利润为本期实现收益扣除本基金各项费用后的余额。
2、本报告期末基金份额持有人户数及基金份额持有人数统计口径按照中国证券登记结算有限责任公司《基金登记结算业务实施细则》的有关规定执行。
3、本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。
4、本基金本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。
5、本基金本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。



大成优选股票基金业绩走势图: 展示了基金自成立以来的净值增长率与沪深300指数和中债国债综合指数的历史走势对比。

§4 基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏庆生	基金经理	2008年8月1日	—	17年	硕士学历，2001年加入大成基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、基金经理。2008年3月加入大成基金管理有限公司，现任基金经理。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。
2、证券从业年限指从事证券行业的工作年限。
3、本基金的投资范围包括股票、债券、货币市场基金、权证、股指期货等。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。债券资产占基金资产净值的比例不高于10%。权证资产占基金资产净值的比例不高于3%。股指期货资产占基金资产净值的比例不高于5%。现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金将根据法律法规的规定进行资产配置调整。
4、本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。债券资产占基金资产净值的比例不高于10%。权证资产占基金资产净值的比例不高于3%。股指期货资产占基金资产净值的比例不高于5%。现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金将根据法律法规的规定进行资产配置调整。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,500,094,135.44	84.04
2	固定收益投资	190,420,000.00	6.38
3	金融衍生品投资	—	0.00
4	买入返售金融资产	—	0.00
5	其他金融资产	290,634,786.06	9.43
6	其他	1,060,002,633.50	35.16

§6 开放式基金份额变动

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期基金净申购	15,796,327.66
2.本期基金净赎回	-10,727,747.13
3.本期基金净申购/赎回	5,068,580.53
4.期末基金净申购	513,907,040.40
5.期末基金净赎回	-1,024

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。



大成优选股票基金业绩走势图: 展示了基金自成立以来的净值增长率与沪深300指数和中债国债综合指数的历史走势对比。

§1 重要提示

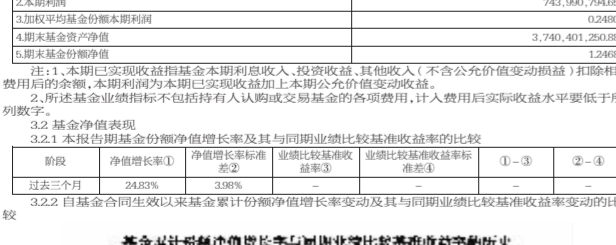
基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的投资业绩并不预示其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本财务报告财务数据未经审计。
本报告日期自2009年1月1日起至2009年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	大成债券
交易代码:	160401
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	1999年12月30日
报告期末基金份额总额:	7,000,000,000.00份
投资策略:	本基金将在对宏观经济、利率、债券市场基本面分析的基础上，采用自上而下的投资策略，合理配置固定收益类资产，追求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准:	中债综合指数
风险收益特征:	本基金属债券型基金，预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，属于低风险投资品种。
基金管理人:	大成基金管理有限公司
基金托管人:	中国银行股份有限公司

§3 主要财务数据和净值表现

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期实现收益	391,306,260.66
2.本期基金份额持有人损益	793,360,784.06
3.期末可供分配基金份额	6,940,000,000.00
4.期末可供分配利润	3,740,401,260.66
5.期末基金份额净值	1.26
6.期末基金份额持有人户数	6,068



大成债券基金业绩走势图: 展示了基金自成立以来的净值增长率与中债综合指数的历史走势对比。

§4 基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏庆生	基金经理	2008年8月23日	—	8年	硕士学历，2001年加入大成基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、基金经理。2008年8月加入大成基金管理有限公司，现任基金经理。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。
2、证券从业年限指从事证券行业的工作年限。
3、本基金的投资范围包括股票、债券、货币市场基金、权证、股指期货等。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不超过30%。债券资产占基金资产净值的比例不低于70%。权证资产占基金资产净值的比例不超过3%。股指期货资产占基金资产净值的比例不超过5%。现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金将根据法律法规的规定进行资产配置调整。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,940,044,726.61	77.27
2	固定收益投资	764,202,522.10	20.30
3	金融衍生品投资	—	0.00
4	买入返售金融资产	18,784,379.88	0.50
5	其他金融资产	12,951,730.88	0.34
6	其他	3,806,343,003.89	100.00

§6 开放式基金份额变动

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期基金净申购	2,940,044,726.61
2.本期基金净赎回	-764,202,522.10
3.本期基金净申购/赎回	2,175,842,204.51
4.期末基金净申购	2,175,842,204.51
5.期末基金净赎回	—

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。

大成优选股票型证券投资基金

2009年第一季度报告

2009年3月31日
基金管理人:大成基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2009年4月20日

§1 重要提示

基金管理人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2009年4月16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，基金的投资业绩并不预示其未来表现。投资者有风险，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。
本财务报告财务数据未经审计。
本报告日期自2009年1月1日起至2009年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	大成优选股票
交易代码:	160402
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2008年8月1日
报告期末基金份额总额:	1,407,000,709.09份
投资策略:	在符合基金合同的前提下，本基金将在股票市场上，根据对宏观经济、行业、公司基本面分析，主要采用自上而下的主动投资策略，获取超额收益。投资组合比例调整、资产配置调整、风险控制过程、分散资产配置并追求超额收益。
业绩比较基准:	80%×沪深300指数+20%×中债国债综合指数
风险收益特征:	本基金属股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金和债券型基金，属于较高风险投资品种。
基金管理人:	大成基金管理有限公司
基金托管人:	中国银行股份有限公司

§3 主要财务数据和净值表现

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期实现收益	-216,726,647.27
2.本期基金份额持有人损益	590,589,187.47
3.期末可供分配基金份额	1,260,000,000.00
4.期末可供分配利润	3,076,974,406.27
5.期末基金份额净值	2.18
6.期末基金份额持有人户数	6,068

注:1、本期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。本期利润为本期实现收益扣除本基金各项费用后的余额。
2、本报告期末基金份额持有人户数及基金份额持有人数统计口径按照中国证券登记结算有限责任公司《基金登记结算业务实施细则》的有关规定执行。
3、本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。
4、本基金本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。
5、本基金本报告期末可供分配利润为截至本报告期末可供分配利润扣除本报告期末应付未付的基金管理人报酬、基金托管费、销售服务费、基金份额持有人红利等费用后的余额。



大成优选股票基金业绩走势图: 展示了基金自成立以来的净值增长率与沪深300指数和中债国债综合指数的历史走势对比。

§4 基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏庆生	基金经理	2008年8月1日	—	17年	硕士学历，2001年加入大成基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、基金经理。2008年3月加入大成基金管理有限公司，现任基金经理。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。
2、证券从业年限指从事证券行业的工作年限。
3、本基金的投资范围包括股票、债券、货币市场基金、权证、股指期货等。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。债券资产占基金资产净值的比例不高于10%。权证资产占基金资产净值的比例不高于3%。股指期货资产占基金资产净值的比例不高于5%。现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金将根据法律法规的规定进行资产配置调整。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,500,094,135.44	84.04
2	固定收益投资	190,420,000.00	6.38
3	金融衍生品投资	—	0.00
4	买入返售金融资产	—	0.00
5	其他金融资产	290,634,786.06	9.43
6	其他	1,060,002,633.50	35.16

§6 开放式基金份额变动

单位:人民币元	
本报告期末	截至2009年3月31日
1.本期基金净申购	15,796,327.66
2.本期基金净赎回	-10,727,747.13
3.本期基金净申购/赎回	5,068,580.53
4.期末基金净申购	513,907,040.40
5.期末基金净赎回	-1,024

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。

大成优选股票型证券投资基金 2009年第一季度报告

§8 投资组合报告

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090008	国债08	1,000,000	106,200,000.00	3.42
2	080217	国债17	500,000	49,846,000.00	1.62
3	090008	国债08	250,000	26,316,000.00	0.82

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 其他组合报告

§8.1 其他组合构成

序号	名称	金额(元)
1	存在保本基金	637,549,112
2	股指期货合约	18,599,687.30
3	股指期货	—
4	股指期货	3,280,447.91
5	股指期货	—
6	股指期货	—
7	股指期货	—
8	合计	20,878,697.21

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受限情况的明细表

§8.6 投资组合报告附注

5.8.6 投资组合报告期内被出具审计意见情况

报告期内无会计师事务所出具审计意见。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	基金名称	报告期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	大成优选股票	50,800,000.00	1.66

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	基金名称	报告期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	大成优选股票	50,800,000.00	1.66

§10 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。

§11 基金管理人声明

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成优选股票基金基金经理变更的公告。

§11 基金管理人声明

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080107	国债07	2,000,000	211,300,000.00	6.28
2	080217	国债17	2,000,000	199,200,000.00	6.07
3	080111	国债11	1,800,000	179,476,000.00	5.26
4	040211	国债11	1,600,000	161,276,000.00	4.83
5	070229	国债29	1,200,000	131,056,000.00	3.84

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 其他组合报告

§8.1 其他组合构成

序号	名称	金额(元)
1	存在保本基金	410,000.00
2	股指期货合约	102,667,909.96
3	股指期货	—
4	股指期货	36,817,904.86
5	股指期货	43,720,389.33
6	股指期货	—
7	股指期货	—
8	合计	171,626,404.33

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受限情况的明细表

本基金本报告期末前十名股票中不存在流受限情况。

§8.6 投资组合报告附注

5.8.6 投资组合报告期内被出具审计意见情况

报告期内无会计师事务所出具审计意见。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	基金名称	报告期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	大成债券	468,222,000.00	13.36
2	大成债券	468,222,000.00	13.36

§10 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。
2、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。
3、本基金管理人已于2009年3月26日披露了关于大成债券基金基金经理变更的公告。

§11 基金管理人声明

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090104	国债04	1,100,000	113,012,000.00	2.97
2	080408	国债08	1,000,000	109,120,000.00	2.82
3	080208	国债08	1,000,000	108,750,000.00	2.81
4	080408	国债08	1,000,000	108,800,000.00	2.82
5	080408	国债08	1,000,000	108,750,000.00	2.81

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 其他组合报告

§8.1 其他组合构成

序号	名称	金额(元)
1	存在保本基金	1,413,303.08
2	股指期货合约	3,786,247.97
3	股指期货	—
4	股指期货	12,666,264.60
5	股指期货	—
6	股指期货	—
7	股指期货	—
8	合计	17,675,901.65

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受限情况的明细表

本基金本报告期末前十名股票中不存在流受限情况。

5.8.6 投资组合报告期内被出具审计意见情况

报告期内无会计师事务所出具审计意见。

5.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内无会计师事务所出具审计意见。