大成精选增值混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2009年第2期

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

重要提示

大成精选增值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监基金字【2004】163号文核准募集，基金合同于2004年12月15日正式生效。

本基金管理人保证更新的招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本更新的招募说明书所载内容截止日为2009年12月15日，有关财务数据和基金净值表现截止日为2009年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

本基金管理人大成基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准发起设立，概况介绍如下：

住　所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人：张树忠
成立日：1999年4月12日
注册资本：贰亿元人民币
股权结构：公司股东为中泰信托投资有限责任公司（持股48%）、中国银河投资管理有限责任公司（持股25%）、光大证券股份有限公司（持股25%）、广东证券股份有限公司（持股2%）。
电话：0755-83183388
传真：0755-83199588
联系人：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设十五个部门，分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、人力资源部、综合财务部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州和沈阳等地设立了七家分公司，并在香港设立了子公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以“稳健、高效”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。公司所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

（二）证券投资基金管理情况

截至2009年12月15日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金，及13只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长股票型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金和大成行业轮动股票型证券投资基金等。

（三）主要人员情况

1、公司高级管理人员

董事会：

张树忠先生，董事长，经济学博士。1989年7月—1993年2月，任中央财经大学财政系讲师；1993年2月—1997年3月，任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理；1997年3月—2003年7月，任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监；2003年7月—2004年6月，任光大保德信基金管理公司董事、副总经理；2004年6月—2006年12月，任大通证券股份有限公司副总经理；2007年1月—2008年1月，任大通证券股份有限公司总经理；2008年1月—2008年4月，任职中国人保资产管理股份有限公司；2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员；2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生，董事总经理，国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月，任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002年9月加入大成基金管理有限公司，历任助理总经理、副总经理；2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

刘虹先生，董事，博士，高级经济师。1985年7月—1998年11月，任国家计委国土局主任科员、副处长（主持工作）；1998年11月—2000年9月，任中国农业发展银行资金计划部计划处副处长（主持工作）；2000年9月—2004年9月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部战略研究与规划处处长；2004年9月—2006年2月，任中国人寿保险（集团）公司战略规划部副总经理；2006年2月—2007年6月，任中国人寿保险股份有限公司发展改革部总经理；2007年6月—2007年8月，任中国人民保险集团公司高级专家；2007年8月至今，任人保投资控股有限公司总裁、党委书记；2009年11月起，兼任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理；长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理；大成基金管理有限公司研究总监；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

孙学林先生，董事，博士研究生在读，中国注册会计师，注册资产评估师。1997年5月—2000年4月，任职于中国长城信托投资公司；2000年4月—2007年2月，任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部；现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987年，任兵器部5107、5137厂生产会计员、财务处长；1987年—1998年，任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理；1998年—2005年，任财政部驻江西专员办专员助理、副专员、专员、党组书记；2005年8月，任中央纪委、中组部金融巡视组局长；2007年1月退休。

于绪刚先生，独立董事，法学博士，环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年，任河北省保定市中级人民法院助理审判员；1995年—1998年，北京大学法学硕士学习；1999年，香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者；1999年—2001年，北京大学法学博士学习；2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生，独立董事，经济学博士，研究员，曾任上海市政府发展研究中心处长，上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长，浦东新区发展计划局党组书记，上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表，上海市公积金管理中心党委书记、主任，上海市政府特聘决策咨询专家，现任浦东改革与发展研究院院长。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行顾问，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

监事会：

胡学光先生，监事长，硕士，高级经济师，广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教，广州金融高等专科学校任金融系副主任；1992年—2003年4月，在广东证券股份有限公司先后任“广证基金”、“广证受益”经理、部门总经理、总裁助理、副总裁，兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长，广东证券博士后科研工作站指导导师；2003年5月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。

宁加岭先生，监事，大学本科。1983年2月—1987年6月，任财政部人教司副处长、处长；1987年6月—1994年6月，任财政部行政司副司长、司长；1994年6月—1999年6月，任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表；1999年6月起，任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生，监事，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员：

刘彩晖女士，副总经理，管理学硕士。1999年—2002年，历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理；2002年—2006年，历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理，期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长；2006年1月—7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006年8月—2008年5月，任大成基金管理有限公司助理总经理；2008年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992年—1994年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人；1994年—1998年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999年3月起，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

2、基金经理

（1）现任基金经理

曹雄飞先生，男，1996年毕业于北京大学概率统计系，获理学学士学位。1999年毕业于北京大学中国经济研究中心国际金融专业，获金融学硕士学位。毕业后先后就职于招商证券北京地区总部、鹏华基金管理公司、景顺长城基金管理公司、大成基金管理公司、建信基金管理有限责任公司等，曾担任行业研究员、宏观经济及投资策略研究员、市场销售和市场推广以及基金经理助理、基金经理等职。2006年1月至2007年6月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理；2007年10月至2008年11月曾任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理。2008年12月加入大成基金管理有限公司。2009年3月起担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，同时任研究部总监，具有基金从业资格。

（2）历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
何光明	2004年12月15日—2006年1月20日
曹雄飞	2006年1月21日—2007年6月26日
钱辉	2007年6月27日—2008年12月17日
张益凡	2008年12月18日—2009年3月25日

3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由9名成员组成，设主任委员1名，其他委员8名。名单如下：

刘明，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员；杨建华，股票投资部总监，负责公司股票投资业务，大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；陈尚前，固定收益部总监，负责公司固定收益证券投资业务，大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；曹雄飞，研究部总监，大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易管理部总监，投资决策委员会委员；施永辉，股票投资部副总监，大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；王立，大成债券投资基金、大成货币市场证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；曹志刚，金融工程部首席金融工程师，投资决策委员会委员；刘安田，研究部总监助理，首席宏观策略分析师，投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
法定代表人：项俊波
成立时间：2009年1月15日
注册资本：2600亿元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-68424199
联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止2009年12月15日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共74只，包括大成精选增值混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金。

三、相关服务机构

（一）销售机构及联系人

1、直销机构：大成基金管理有限公司
住　所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人：张树忠
电话：0755-83183388
传真：0755-83199588
联系人：梁靖
公司网址：www.dcfund.com.cn
全国统一客户服务号码：021-53599588、400-888-5558（免固话长途费）
大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心：
（1）大成基金深圳投资理财中心
地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人：梁靖、瞿宗怡
电话：0755-83195236
传真：0755-83195091
（2）大成基金北京投资理财中心
1）东直门
电话：010-58156152/53
传真：010-58156315/23
地址：北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦105室
联系人：李宁
2）平安里
电话：010-85252345/46
传真：010-85252272/73
地址：北京市西城区平安里西大街28号光大国际中心1601室
联系人：廖红军
（3）大成基金上海投资理财中心
1）广东路
地址：上海市广东路689号海通证券大厦19层
联系人：徐舲
电话：021-63513925/26
传真：021-63513928
2）南京西路
地址：上海市静安区南京西路580号南证大厦102、103室
联系人：朱君
电话：021-62185377、62185277
传真：021-62185233
2、代销机构
（1）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
客服电话：95599
联系人：蒋浩
电话：010-85109219
传真：010-85109219
网址：www.abchina.com
（2）中国银行股份有限公司
注册地址：北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
客服电话：95566
传真：010-66594946
电话：010-66594977
网址：www.boc.cn
（3）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼
法定代表人：郭树清
联系人：王琳
电话：010-67596084
传真：010-66275654
客服电话：95533
网址：www.ccb.com
（4）中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客服电话：95588
联系人：田耕
电话：010-66107900
传真：010-66108013
网址：www.icbc.com.cn
（5）上海浦东发展银行股份有限公司
办公地址：上海市北京东路689号17楼
法定代表人：吉晓辉
联系人：倪苏云
客服热线：95528
电话：021-61618888
传真：021-63602431
网址：www.spdb.com.cn
（6）浙商银行股份有限公司
注册地址：杭州市庆春路288号（办公地址同注册地址）
法定代表人：张达洋
客户服务热线：95105665
联系人：吴军阳
电话：0571-87659084
传真：0571-87659188
网址：www.czbank.com
（7）深圳发展银行股份有限公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：法兰克纽曼（Frank N.Newman）
客服电话：95501
联系人：周勤
电话：0755-82088888-8811
传真：0755-82080714
网址：www.sdb.com.cn
（8）交通银行股份有限公司
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
客服电话：95559
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408842
网址：www.bankcomm.com
（9）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行股份有限公司大厦
法定代表人：秦晓
客服电话：95555
联系人：刘薇
电话：0755-83195915
传真：0755-83195061
网址：www.cmbchina.com
（10）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
客服电话：95595
联系人：李伟
电话：010-68560675
传真：010-68560661
网址：www.cebbank.com
（11）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区正义路4号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
客服电话：95568
联系人：董云巍
电话：010-58351666-8155
传真：010-83914283
网址：www.cmbc.com.cn
（12）广东发展银行股份有限公司
注册地址：广州市农林下路83号
法定代表人：李若虹
客服电话：95508
电话：020-87310888
网址：www.gdb.com.cn
（13）北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
客服电话：010-96169（北京）、022-96269（天津）、021-53599688（上海）、029-85766888（西安）、0755-23957088（深圳）、0571-86590900（杭州）
网址：www.bankofbeijing.com.cn
（14）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号
法定代表人：李秀仑
电话：021-38576977
传真：021-62521689
联系人：吴海平、翁敏芬
客服电话：021-962999
网址：www.shrcb.com
（15）平安银行股份有限公司
注册地址：中国深圳市深南中路1099号
法定代表人：黄立哲
电话：0755-25859591
传真：0755-25878304
联系人：霍兆龙
客户服务热线：0755-961202、4006699999
公司网站：www.18ebank.com
（16）温州银行股份有限公司
注册地址：温州市车站大道华海广场1号楼
法定代表人：夏瑞洲
客服电话：0577-96699
网址：www.wzbank.cn
（17）青岛银行股份有限公司
地址：青岛市市南区香港中路68号华普大厦
法定代表人：张广鸿
联系人：滕克
客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）
网址：www.qdccb.com
（18）杭州银行股份有限公司
地址：杭州市凤起路432号
法定代表人：马时雍
联系人：陈振峰
客服电话：96523、4008888508
网址：www.hzbank.com.cn
（19）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市江东区中山东路294号
法定代表人：陆华裕
电话：021-63586210
传真：021-63586215
联系人：胡技勋
客服电话：96528、上海地区962528
网址：www.nbcb.com.cn
（20）东莞银行股份有限公司
注册地址：东莞市运河东一路193号
法定代表人：廖玉林
联系人：胡昱
客服电话：96228
网址：www.dongguanbank.cn
（21）江苏银行股份有限公司
地址：南京市洪武北路55号
法定代表人：黄志伟
联系人：田春慧
联系电话：025-58588167
客户服务电话：96098、400-86-96098
网址：www.jsbchina.cn
（22）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
联系电话：021-63219781
客服电话：4008-888-999
委托电话：4008-888-318
传真：027-85481900
网址：www.cjsc.com.cn
（23）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
通讯地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人：祝幼一
客服电话：400-8888-666
联系人：芮敏祺
电话：021-62580818-213
传真：021-62583439
网址：www.gtja.com
（24）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
通讯地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
客服电话：400-8888-108
联系人：魏明
电话：010-85130579
网址：www.csc108.com
（25）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客服电话：4008888111、95565
联系人：黄健
电话：0755-82943511
传真：0755-83734343
网址：www.newone.com.cn
（26）广发证券股份有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
法定代表人：王志伟
客服电话：020-87555888转各营业网点
联系人：肖中梅
电话：020-87555888-875
传真：020-87557985
网址：www.gf.com.cn
（27）中国银河证券股份有限公司
通讯地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：胡长生
客服电话：4008-888-888
联系人：李洋
联系电话：010-66568047
传真：010-66568536
网址：www.chinastock.com.cn
（28）华泰联合证券有限责任公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：马昭明
客服电话：400-8888-555
联系人：盛宗凌
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
网址：www.lhzq.com
（29）申银万国证券股份有限公司
通讯地址：上海市常熟路239号2楼
法定代表人：丁国荣
客服电话：021-962505
联系人：曹晔
电话：021-54047892
传真：021-54038844
网址：www.sw2000.com.cn
（30）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
客服电话：95553、400-888-8001
联系人：金芸
电话：021-23219000
传真：021-63602722
网址：www.htsec.com
（31）中信证券股份有限公司
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
客服电话：010-84588888各地营业部咨询电话
联系人：陈忠
电话：010-84683893
传真：010-84865560
网址：www.cs.ecitic.com
（32）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
客服电话：4008001001
联系人：张茜萍
电话：0755-82558335
传真：0755-82558335
网址：www.axzq.com.cn
（33）光大证券股份有限公司
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
客服电话：4008888788、10108998
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169081
传真：021-22169134
网址：www.ebscn.com
（34）华林证券有限责任公司
办公地址：珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
法定代表人：段文清
客服电话：0750-3160388各地营业部客户服务电话
联系人：杨玲
电话：0755-82707855
传真：0755-82707850
网址：www.chinalions.com
（35）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址；青岛市东海西路28号
法定代表人：史洁民
客服电话：0532-96577
联系人：丁韶燕
电话：0532-85022026
传真：0532-85022026
网址：www.zxwt.com.cn
（36）东海证券有限责任公司
注册地址：常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼
法定代表人：朱科敏
客服电话：0519-88166222、0379-64902266、021-52574550
联系人：李涛
电话：021-50586660
传真：021-50586660-8880
网址：www.longone.com.cn
（37）中信金通证券有限责任公司
注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
电话：0571-96598
传真：0571-85783771
联系人：王勤
联系电话：0571-85783715
网址：www.bigsun.com.cn
（38）广州证券有限责任公司
注册地址：广州市先烈中路69号主楼五楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人：吴志明
客服电话：020-961303
联系人：江欣
联系电话：020-87320991
传真：020-87325036
网址：www.gzs.com.cn
（39）平安证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：陈敬达
客服电话：95511
联系人：袁月
电话：0755-22627802
传真：0755-83433794
网址：www.pa18.com
（40）华泰证券有限责任公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客服电话：4008-888-168、95597
联系人：李金龙、张小波
电话：025-84457777-950、248
网址：www.htsc.com.cn
（41）湘财证券股份有限公司
住所：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：上海陆家嘴环路958号华能联合大厦5层
法定代表人：陈学荣
客服电话：400-888-1551
联系人：钟康莺
电话：021-68634518
传真：021-68865680
网址：www.xcsc.com
（42）国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号
公司办公地址：安徽省合肥市寿春路179号（邮政编码：230001）
法定代表人：凤良志
客服电话：400-888-8777、0551-95888
联系人：程维
电话：0551-2634400
传真：0551-2645709
网址：www.gyzq.com.cn
（43）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号
办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：蒋元真
客服电话：021-962518
联系人：谢秀峰
电话：021-51539888
传真：021-65081063
网址：www.962518.com
（44）华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
客服电话：0551-96518、400-80-96518
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
网址：www.hazq.com
（45）兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦18楼
法定代表人：兰荣
电话：021-68419974
传真：021-68419867
联系人：杨盛芳
网址：www.xyzq.com.cn
客服电话：400888123
（46）财通证券有限责任公司
注册地址：杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
电话：0571-87925129
传真：0571-87925129
网址：www.ctsec.com
客户服务电话：0571-96336
（47）浙商证券有限责任公司
地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人：吴承根
联系人：吴颖
电话：0571-87901963
传真：0571-87902081
网址：www.stocke.com
（48）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址：天津市河西区宾水道3号
法定代表人：张志军
客服电话：4006515988
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客服电话：28455588
网址：www.ewww.com.cn
（49）方正证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市建湘路479号
法定代表人：雷杰
客服电话：0571-95571、0731-95571、13258915782
电话：0731-2882340、0571-87782047
传真：0731-2882332
网址：www.foundersc.com
（50）东莞证券有限责任公司
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：游锦辉
客服电话：0769-961130
联系人：张建平
电话：0769-22119426
传真：0769-22119423
网址：www.dgzq.com.cn
（51）瑞银证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：刘弘
电话：010-59226788
传真：010-59226840
联系人：谢亚凡
客户服务电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com
（52）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人：汤世生
联系人：韩梅
电话：010-62294608-6957
传真：010-62296854
客户服务电话：010-62294600
网址：www.hysec.com
（53）长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
电话：0755-83516289
传真：0755-83516199
客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888
长城证券网站：www.cc168.com.cn
（54）国都证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4028号荣超经贸中心26层11、12
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人：王少华
联系人：黄静
客户服务电话：800-810-8809
网址：www.guodu.com
（55）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：85096709
客户服务电话：0431-96688-0、0431-85096733
网址：www.nesc.cn
（56）江海证券有限公司
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表：孙名扬
电话：0451-82269286
客服热线：4006662288
联系人：葛新
网址：www.jhzq.com.cn
（57）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人：李剑阁
联系人：王雪筠
客服电话：（010）85679238、（010）85679169
网址：www.ciccs.com.cn
（58）恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法人代表：刘汝军
客户服务电话：0471-4961259
联系人：张同亮
电话：021-68405273
网址：www.cnht.com.cn
（59）国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市等城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：冉云
联系人：金喆
客户服务电话：028-86690126
网址：www.gjzq.com.cn
（60）信泰证券有限责任公司
办公地址：江苏省南京市长江路88号国信大厦18、19楼（邮政编码：210005）
法定代表人：钱凯法
客服电话：400-8888-918
联系人：舒萌菲
电话：025-84784765
传真：025-84784830
网址：www.thope.com
（61）国海证券有限责任公司
注册地址：广西南宁市滨湖路46号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号
客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）
法定代表人：张雅锋
联系人：覃清芳
电话：0771-5539262
传真：0771-5539033
网址：www.ghzq.com.cn
（62）江南证券有限责任公司
注册地址：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号六楼
法定代表人：姚江涛
客服电话：0791-6768763
联系人：余雅娜
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
网址：www.scstock.com
（63）爱建证券有限责任公司
地址：上海市南京西路758号24楼
法定代表人：张建华
客服电话：021-63340678
联系人：陈敏
网址：www.ajzq.com
（64）英大证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：赵文安
客服电话：0755-26982993
网址：www.vsun.com
（65）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服电话：95536
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133302
网址：www.guosen.com.cn
（66）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客服电话：400-666-1618
联系人：张治国
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn
（67）广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦8层
法定代表人：黄金琳
客服电话：0591-87383623
联系人：张腾
传真：0591-87383610
网址：www.gfhfzq.com.cn
（68）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29楼
法定代表人：王益民
客户电话：95503
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63327888
网址：www.dfzq.com.cn
（69）中原证券股份有限公司
地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人：石保上
客服电话：0371-967218、4008139666
联系人：程月艳、耿铭
网址：www.ccnew.com
（70）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
客服电话：（010）66045678
网址：www.txsec.com、www.txjijin.com
（71）西南证券股份有限公司
地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
客服电话：4008096096
联系人：徐雅筠、杨再巧
网址：www.swsc.com.cn
（72）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com
（73）金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层（邮政编码：570206）
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼（邮政编码：518034）
法定代表人：陆涛
客服电话：4008-888-228
联系人：张萍
传真：0755-83025625
网址：www.jyzq.cn
（74）国联证券股份有限公司
注册地址：江苏省无锡市县前东街168号
办公地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦703室
法定代表人：范炎
客服电话：0510-82588168
联系人：袁丽萍
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
网址：www.glsc.com.cn

（二）注册登记机构
名　称：大成基金管理有限公司
住　所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人：张树忠
电话：0755-83183388
传真：0755-83195239
联系人：范瑛

（三）律师事务所和经办律师
律师事务所名称：通力律师事务所
注册地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师：秦悦民、傅轶
电话：021-68818100
传真：021-68816880

（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、金毅
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：金毅

四、基金的名称

大成精选增值混合型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：契约型

六、基金的运作方式

基金运作方式：开放式

七、基金的投资目标

投资于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。

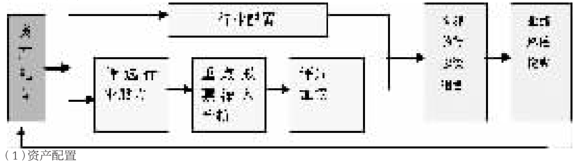
八、基金的投资范围

投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资比例范围为基金资产的40%-95%，为了满足投资者赎回要求，基金持有现金及到期日在一年以内的政府国债的比例不低于基金资产净值的5%，债券投资比例范围为基金资产的0%-55%。

九、基金的投资策略

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力比较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。

本基金股票投资流程如下图所示：



（1）资产配置

根据宏观经济指标、市场价值指标、投资者气氛指标、盈利预测指标、证券市场流动性指标等相关因素的综合分析，对股票、债券的风险和收益率进行预测。利用情景分析对上述预测进行分析，确定股票投资组合的资产配置比例。

（2）行业配置

本基金通过定性定量的方法确定行业配置比例。

基金管理人将根据对宏观经济变化及行业结构调整的分析判断，确定行业配置比例。

确定行业配置的主要依据为：根据竞争优势分析，确定行业中具有竞争优势和比较竞争优势的行业范围。根据多因素模型分析确定每个行业的内在价值，以及行业价格向内在价值回归的速度，结合均值方差分析确定行业配置比例范围。

行业配置的主要步骤为：

①通过以下分析，确定行业相对投资价值

对全球、地区、国内行业发展趋势和发展环境进行分析，判断行业或产品的增长前景（全球观念下，行业景气趋势分析）

宏观经济周期对行业发展的影响（宏观分析）

优势行业的发展模式分析（评价商业模式）

该行业财务状况分析（财务稳健性分析）

②根据多因素模型分析，确定行业配置比例范围

利用多因素模型通过对宏观经济变量、价值变量、增长变量、盈利变量、动量变量等多种因素指标的定量分析，确定每个行业的内在价值，以及行业价格向内在价值回归的速度，利用结合均值方差分析有效边界确定行业配置比例范围。

分析模式可以分为三步：

第一步利用长期模型估计每个行业和影响其基本因素的长期依赖关系，同时估计行业价值与其内在价值的偏离程度，这里我们利用DDM模型作为估计行业内在价值的框架模型。

第二步结合经验和实证分析结论，对不同行业设定不同的影响因素。利用短期动态模型分析每个行业价值向其内在价值回归的速度和各行业收益率的预测水平。

第三步利用定性和定量相结合的方式，确定优势行业，结合均值-方差分析确定行业投资组合比例范围。

（3）个股选择

①首先对股票市值大小进行排序，挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票，作为模型的基础股票库。

②对股票投资价值和股票预期收益增长性进行定量分析与评分筛选：

通过选取与股价变动有较强相关性的每股预期收益增长率、市盈率、市净率、市销率（P/S）、流通市值等基本因素和技术因素为指标，对基础股票库中各行业股票的投资价值和预期收益增长性进行定量分析与评分筛选，在剔除掉通过不公允关联交易、非经常性收益等方式实现净利润大幅增长的个股后，组成股票备选库（本基金将新股申购作为一个特殊资产类看待，单独管理）。

③通过商业评估、公司评估、价值评估、盈利预测和市场表现对备选股票库上市公司进行综合比较，按照比较后的优先顺序，在备选股票库中寻找价格合理、基本面良好、具有一定上涨空间的股票。

（4）构建执行投资组合

基金经理按以下步骤建立投资组合：

①对当前的投资策略进行分析评估；

②基于“自上而下”进行的资产配置与行业配置，基于“自下而上”选择的股票，结合基金经理自身的研究分析，构建、执行投资组合。

本基金为风险收益中等偏高的基金产品，充分重视对债券的投资。债券投资时，将综合考虑利率变化对不同债券的收益率水平、信用风险、流动性等因素的影响，利用债券定价模型对债券价格进行分析，确定债券投资品种。基金经理统一负责本基金的债券投资。根据投资决策委员会确定的资产配置比例，并结合资金量及流动性要求提出债券投资执行方案。

（5）业绩风险控制

金融工程部运用大成基金管理有限公司风险控制模型，对投资组合的风险构成进行度量预测分析。基金经理跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及对基金投资组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。监察稽核部负责对基金投资过程进行日常监督。

十、基金的业绩比较基准

新华富时中国A600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%

十一、基金的风险收益特征

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、主动的行业配置，使得本基金成为证券投资基金中风险程度中等偏高的基金产品，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、纯债券基金和国债。

十二、基金的投资组合报告(截至2009年9月30日)

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根据基金合同规定，于2010年1月12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。

本投资组合报告所载数据截至2009年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,120,389,630.66	86.45
	其中：股票	3,120,389,630.66	86.45
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	484,638,676.41	13.43
6	其他资产	4,430,220.02	0.12
7	合计	3,609,458,527.09	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	38,428,594.13	1.08
B	采掘业	377,247,624.48	10.62
C	制造业	1,203,230,727.99	33.88
C0	食品、饮料	251,054,777.60	7.07
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	252,560,657.74	7.11
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	329,008,678.11	9.26
C7	机械、设备、仪表	257,158,076.32	7.24
C8	医药、生物制品	92,208,538.22	2.60
C99	其他制造业	21,240,000.00	0.60
D	电力、煤气及水的生产和供应业	39,075,000.00	1.10
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	32,174,000.00	0.91
G	信息技术业	15,482,616.00	0.44
H	批发和零售贸易	146,169,927.76	4.12
I	金融、保险业	742,193,532.10	20.90
J	房地产业	336,362,570.12	9.47
K	社会服务业	105,450,000.00	2.97
L	传播与文化产业	18,036,000.00	0.51
M	综合类	66,539,038.08	1.87
	合计	3,120,389,630.66	87.85

（三）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明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,000,000	152,100,000.00	4.28
2	600585	海螺水泥	3,099,923	133,389,686.69	3.76
3	002142	宁波银行	8,275,576	110,727,206.88	3.12
4	000983	西山煤电	3,499,598	109,572,413.38	3.08
5	000568	泸州老窖	3,699,711	108,771,503.40	3.06
6	601166	兴业银行	3,149,751	106,430,086.29	3.00
7	000069	华侨城A	5,700,000	105,450,000.00	2.97
8	000024	招商地产	3,699,806	92,495,150.00	2.60
9	600132	重庆啤酒	4,499,919	89,728,384.86	2.53
10	600703	三安光电	2,945,906	89,467,165.22	2.52

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

（五）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债券明细

本基金本报告期末无债券投资。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

(下转B16版)