

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF) 2008年第一季度报告

一、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...

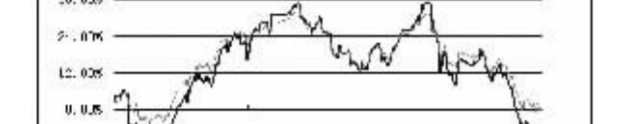
二、基金产品概况
1.基金名称：大成创新
2.基金代码：160910
3.基金运作方式：契约型上市开放式

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
1.本期利润 -6,223,915.43340
2.本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 -297,627,001.84

Table with 5 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 本期利润, 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额, etc.

注：1.上述基金业绩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字。
2.上述所列数据截止到2008年3月31日。

(二)大成创新成长混合型证券投资基金净值表现
1.大成创新成长混合型证券投资基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1.本基金合同约定，大成创新成长混合型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。截至本报告期末本基金的资产配置比例已达到基金合同规定的各项比例要求。

四、管理人报告
(一)基金经理小组简介
基金经理：王德刚

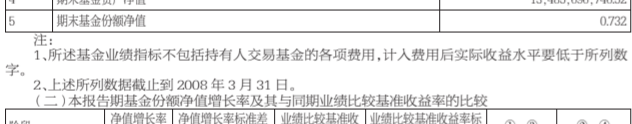
一、重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

二、基金产品概况
1.基金名称：大成2020
2.基金代码：160910
3.基金运作方式：契约型开放式

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
1.本期利润 -4,529,094.29751
2.本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 -172,128.38362

注：1.上述所列数据截止到2008年3月31日。
2.上述所列数据截止到2008年3月31日。

(二)大成2020基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1.本基金合同约定，大成2020基金各个时间段的资产配置比例如下：
(一)基金资产配置
股票 30%-40%

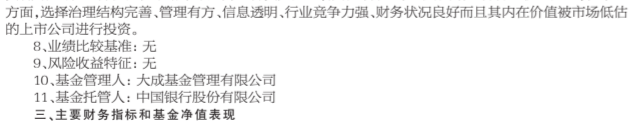
一、重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

二、基金产品概况
1.基金名称：基金宏安
2.基金代码：159401
3.基金运作方式：契约型封闭式

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
1.本期利润 -1,736,208.97663
2.本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 684,341.06427

注：1.上述基金业绩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字。
2.所列数据截止到2008年3月31日。

(二)大成宏安基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1.本基金合同约定，大成宏安基金各个时间段的资产配置比例如下：
(一)基金资产配置
股票 30%-40%

王德刚先生，基金经理，浙江大学管理学硕士、南开大学经济学博士，12年证券从业经历。1996年起历任君安证券有限公司研究所高级研究员、国泰君安证券股份有限公司研究员、新华基金管理有限公司副经理主管、国信证券股份有限公司投资经理、巨田基金管理有限公司副经理主管...

二、市场回顾与展望
回顾2007年，我国的宏观经济运行总体呈现出高速增长的趋势，GDP增速超过11%，而与此同时，通货膨胀已经呈现出全面上涨的趋势。在这样的背景下，2007年底中央经济工作会议提出了“防止经济过热”的基调，旨在保持经济平稳较快增长，防止价格总水平过快上涨。

三、基金业绩表现
截至报告期末，本基金份额净值为0.9360元，本报告基金份额净值增长率为-28.36%，同期业绩比较基准增长率为-20.14%，低于业绩比较基准的表现。

四、基金管理人报告
(一)基金管理人报告
截至报告期末，本基金份额净值为0.9360元，本报告基金份额净值增长率为-28.36%，同期业绩比较基准增长率为-20.14%，低于业绩比较基准的表现。

五、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合情况
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
股票 4,230,036.46384 26.49%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
行业 市值(元) 占基金资产净值比例
A 农林牧渔 162,375,265.44 1.06%

(三)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(四)报告期末按品种分类的债券投资组合
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
国债 10,387,122.46518 68.50%

(五)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(六)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(七)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(八)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(九)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十一)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十二)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十三)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十四)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十五)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十六)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十七)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十八)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十九)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(二十)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(二十一)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(二十二)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(二十三)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include C1 纺织、服装、皮毛, C2 木材、家具, C3 造纸、印刷, etc.

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include C5 电子, C6 金属、非金属, C7 机械、设备、仪表, etc.

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include F 交通运输、仓储业, G 信息技术业, H 批发和零售贸易, etc.

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include M 综合类, N 其他, 合计.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 000088 招商局, 2 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 3 000729 中航光电, 4 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 5 600088 中铝国际, 6 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 7 600262 中海发展, 8 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 9 000090 双钱股份, 10 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 11 000088 招商局, 12 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 13 000729 中航光电, 14 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 15 600088 中铝国际, 16 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 17 600262 中海发展, 18 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 19 000090 双钱股份, 20 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 21 000088 招商局, 22 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 23 000729 中航光电, 24 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 25 600088 中铝国际, 26 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 27 600262 中海发展, 28 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 29 000090 双钱股份, 30 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 31 000088 招商局, 32 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 33 000729 中航光电, 34 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 35 600088 中铝国际, 36 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 37 600262 中海发展, 38 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 39 000090 双钱股份, 40 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 41 000088 招商局, 42 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 43 000729 中航光电, 44 600040 中国网通, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 1,218,302,824.50, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 3 应收利息, 4 应收申购款, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 5 其他应收款, 6 待摊费用, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 7 应付债券, 8 预收账款, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 9 其他应付款, 10 应付利息, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 11 应付股利, 12 其他负债, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 13 合计, 1,218,302,824.50, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 合计, 635,910,000.00, 4.72%.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

大成财富管理2020生命周期证券投资基金 2008年第一季度报告

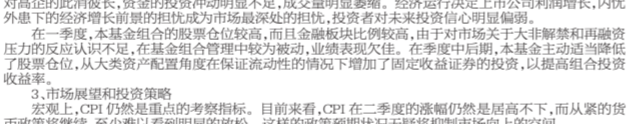
一、重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

二、基金产品概况
1.基金名称：大成财富管理2020
2.基金代码：160910
3.基金运作方式：契约型开放式

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
1.本期利润 -4,529,094.29751
2.本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 -172,128.38362

注：1.上述所列数据截止到2008年3月31日。
2.上述所列数据截止到2008年3月31日。

(二)大成财富管理2020基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1.本基金合同约定，大成财富管理2020基金各个时间段的资产配置比例如下：
(一)基金资产配置
股票 30%-40%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
行业 市值(元) 占基金资产净值比例
A 农林牧渔 162,375,265.44 1.06%

(三)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(四)报告期末按品种分类的债券投资组合
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
国债 10,387,122.46518 68.50%

(五)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(六)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(七)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(八)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(九)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十一)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十二)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

(十三)报告期末按公允价值层级划分的金融资产
项目 金额(元) 占基金资产净值比例
公允价值层级一 798,201,502.30 4.94%

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 股票, 债券, 货币市场基金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 权证, 资产支持证券, 其他, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 其他资产, 合计.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 000088 招商局, 2 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 3 000729 中航光电, 4 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 5 600088 中铝国际, 6 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 7 600262 中海发展, 8 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 9 000090 双钱股份, 10 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 11 000088 招商局, 12 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 13 000729 中航光电, 14 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 15 600088 中铝国际, 16 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 17 600262 中海发展, 18 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 19 000090 双钱股份, 20 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 21 000088 招商局, 22 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 23 000729 中航光电, 24 600040 中国网通, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 25 600088 中铝国际, 26 600019 宝钢股份, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 27 600262 中海发展, 28 607088 中国神华, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 29 000090 双钱股份, 30 000089 华泰A, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 31 000088 招商局, 32 000728 中航电子, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例. Rows include 33 000729 中航光电, 34 600040 中国网通, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1 国债, 2 金融债, 3 央行票据, etc.

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 4 企业债, 5 可转债, 6 其他, etc.

Table with 4 columns: 序号,