# 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

2008年第1号

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

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审核同意,但中国证监会对本基金做出的任何决定,均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。

基金管理人承诺以诚实信用、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,投资人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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,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。基金投资人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》。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2008年6月15日,有关基金净值表现截止日为2008年3月31日,有关基金投资组合及财务数据截止日为2008年3月31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:胡学光

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:李宏伟

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会,下设十个部门,分别是投资部、交易部、金融工程部、规划发展部、委托投资部、市场部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、国际业务部和综合管理部;此外,还设立了投资决策委员会和风险控制委员会。

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,力求为投资人获得更大投资回报。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2008年6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、大成优选基金,及10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、大成创新成长混合型证券投资基金和大成景阳领先股票型证券投资基金。

(三)主要人员情况

1、公司高级管理人员

董事会:

胡学光先生,董事长,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月起任大成基金管理有限公司董事长。

于华先生,董事,总经理,工商管理硕士,金融博士,美国注册金融分析师(CFA)。1989年-1991年,任英国里丁大学经济系金融财务讲师;1991年-1997年,加拿大魁北克大学管理学院金融终身教授;1997年-2000年,任深圳证券交易所综合研究所所长;2000年-2004年1月,任加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁,加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表;现任中国证券业协会基金业委员会副主任委员;2004年1月起任大成基金管理有限公司总经理。

徐浩明先生,董事,硕士研究生。1988年7月-1991年4月,任职于上海体制改革研究所;1991年4月-2000年6月,历任交通银行研究开发部副主任科员、主任科员,办公室综合处副处长、处长,党委办公室综合处处长兼党委秘书;2000年6月-2003年2月,历任中国光大集团有限公司董事会秘书,执董办及党办副主任,办公厅、党办、执董办主任;2002年9月起始任光大证券股份有限公司董事;2003年2月至今,任光大证券股份有限公司董事、副总裁、总裁。

王长林先生,董事,研究生,高级经济师。曾任中国农业银行天津分行计划处副处长、信息中心副总经理,中国长城信托投资公司计划财务部总经理,现任中国银河投资管理有限公司办公室主任。

蔡红标先生,董事,经济学博士。1994年2月-1997年2月,在华泰证券有限责任公司工作。1997年3月-1997年6月,任深圳证券交易所综合研究所研究员;1997年6月-1997年9月,任招商证券有限责任公司研究部研究员;1997年10月-2000年5月,任联合证券有限责任公司研究部副总经理级研究员,分管公司证券市场研究咨询业务;2000年6月-2001年11月,任二十一世纪科技投资有限公司(招商银行控股)证券投资部副总经理;2001年11月至今,在中国华闻投资控股有限公司,任总裁助理、计划部副总经理,担任联合证券有限责任公司董事、中国人民健康保险股份有限公司董事、中国财产再保险股份有限公司监事。

杨建文先生,独立董事,经济学博士、研究员,国务院特殊津贴获得者。1982年-1996年,上海社会科学院经济研究所研究室主任;1996年至今,上海社会科学院部门经济研究所副所长,总支书记;兼任十一届上海市工商联(商会)副会长、上海市人民政府特聘决策咨询研究专家、上海市国有资产规划投资委员会常任委员、上海国际金融研究中心副理事长、上海社会科学院金融研究中心主任。

胡春元先生,独立董事,经济学(会计)博士,中国注册会计师。1991年-1994年,在厦门大学会计师事务所兼职,任审计员;1994年-1995年,任厦门会计师事务所项目经理;1996年-1997年,在深圳大华天诚会计师事务所兼职从事审计与管理咨询工作;1997年11月起,在深圳大华天诚会计师事务所专职从事审计与管理咨询工作,历任经理、合伙人(1999)、高级合伙人、注册会计师。

查竞传先生,独立董事,比较法硕士,美国纽约州注册律师,1984年创办竞诚国际律师事务所,1984年-1994年兼任台湾大学纽约校友会理事,1988年-1992兼任纽约华人参政会理事、会长,1991年-1996年兼任银川市人民政府顾问,1992年-1996年兼任台湾国民大会代表,1999年-2001年兼任中国大学生创业投资大赛评委、清华大学创业投资大赛顾问或评委,1995年-2006年任美国竞诚国际律师事务所纽约总部合伙人兼北京代表处首席代表,2006年起任上海邦信阳律师事务所北京分所资深顾问。

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,上海市浦发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,现任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。

监事会:

周洪先生,监事长,经济学博士,1988年8月-1994年8月,任山东财政学院经贸系副主任、副教授;1994年9月-1995年8月北京大学西方经济学博士研究生;1995年9月-1998年8月在光大证券股份有限公司工作,历任研究部负责人、办公室副主任、总裁办主任、总裁助理职务;1998年9月起参与大成基金管理有限公司的筹建,1999年3月-2005年5月,任大成基金管理有限公司副总经理。

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。

沈烁先生,监事,法学学士。1993年7月—1997年6月任职于福建九州商社有限公司,企业管理部、法律顾问室经理助理,1997年7月—2002年2月任职于厦门联合信托投资公司法律事务部总经理,2002年3月一至今任中泰信托投资有限责任公司,法律事务部总经理兼稽核审计部副总经理。

其他高级管理人员:

周一烽先生,副总经理,经济学硕士。1984年-1992年,历任上海市社会科学院经济研究所研究人员、宏观经济研究室副主任、上海企业发展研究所副所长;1992年起历任广联(南宁)投资有限公司总经理特别助理及证券投资业务负责人、上海广联投资有限公司总经理;2001年起任中泰信托投资有限责任公司副总裁;2005年4月任大成基金管理有限公司任助理总经理;2006年5月起任大成基金管理有限公司副总经理;2007年6月27日起担任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。

王颢先生,副总经理,国际工商管理专业博士。2000年12月-2002年9月,任招商证券深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理;2002年9月-2004年6月,任大成基金管理有限公司助理总经理;2004年7月起任大成基金管理有限公司副总经理。

刘彩辉女士,副总经理,管理学硕士。1999年至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年至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月至7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理;2006年8月至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、上海证券部负责人;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。

李宏伟先生,董事会秘书兼助理总经理,法学硕士。1991年07月-1992年05月,任南京旭普电子有限公司总经理助理;1992年06月-1997年02月,任深圳金地(集团)股份有限公司总经理办公室主任、董事会秘书、发展委主任;1997年03月-1998年04月,任光大证券有限公司深圳营业部副总经理;1998年05月-2003年12月,任南方基金管理有限公司综合管理部及市场部高级经理;2004年01月至今,任大成基金管理有限公司董事会秘书兼助理总经理。

2、基金经理

(1)现任基金经理

钱辉先生,硕士,毕业于北京大学和美国耶鲁大学,美国特许金融分析师(CFA)。自1995年起先后在美国雷曼兄弟公司、美国再保险金融产品公司、美国Barra投资咨询公司从事证券交易、投资咨询、投资风险与回报分析、金融产品设计等工作。2004年9月起担任大成基金管理有限公司金融工程部总监;2005年6月至2007年1月担任大成货币基金基金经理;2007年6月27日起担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。

(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 |
| 曹缍飞 | 2006年1月21日—2007年6月26日 |

3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会6名成员组成,设主任和执行主任各1名,其他委员4名。名单如下:

于华,总经理,投资决策委员会主任;周一烽,副总经理,投资决策委员会执行主任、大成积极成长股票型证券投资基金基金经理;刘明,投资部总监,大成优选股票型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;卢纪平,交易部总监,投资决策委员会委员;杨建华,投资部副总监,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,投资部副总监,大成债券投资基金基金经理,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

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:1979年02月23日

注册资金:361亿元人民币

存续期间:持续经营

电话:68424199

联系人:李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。在国内,中国农业银行网点遍布城乡,资金实力雄厚,服务功能齐全,不仅为广大客户所信赖,而且与他们一道取得了长足的进步,已成为中国最大的银行之一。在海外,农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,被《财富》评为世界500强企业之一。中国农业银行已经成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能最齐全的大型国有商业银行之一。

中国农业银行自1979年恢复成立以来,在社会各界的大力支持下,全行员工开拓创新,奋力拼搏,在建设现代商业银行的征途上,积极探索,勇于实践,资金实力显著增强,业务领域不断拓宽,经营结构逐年优化,财务收益大幅跃升,管理水平不断提高,在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时,自身不断成长壮大。

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,表明独立公正第三方对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、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

(二)主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工70名,其中硕士与博士36人,高级会计师、高级经济师、高级工程师10余名,服务团队成员都具有良好的托管业务能力,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

截止2008年3月31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54只,包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景福、基金天华、基金同德、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、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基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选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、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、大成积极成长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、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、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、华夏复兴基金,托管基金份额达2814亿份。

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:胡学光

电话:0755-83183388

传真:0755-83199588

联系人:杨春明

公司网址:www.dcfund.com.cn

全国统一客户服务号码:400-888-5558(免固话长途费)

大成基金管理有限公司现分别在北京、深圳、上海设有投资理财中心:

(1)大成基金管理有限公司北京投资理财中心

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室(邮编:100020)

电话:010-85252345/46

传真:010-85252272/73

联系人:廖红军、李宁

(2)大成基金管理有限公司深圳投资理财中心

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层(邮编:518040)

电话:0755-83195090/5236

传真:0755-83195091

联系人:郑丽芳

(3)大成基金管理有限公司上海投资理财中心

办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦19楼(邮编:200001)

电话:021-63513925/26

传真:021-63513928

联系人:徐龄、朱君

2、代销机构

(1)中国农业银行

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

(4)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

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

(5)深圳市平安银行

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

公司网站:www.18ebank.com

(6)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:蒋超良

客服电话:95559

联系人:杜宇

电话:021-58781234

传真:021-58408842

网址:www.bankcomm.com

(7)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

(8)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

(9)中国光大银行

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:张建春

电话:010-68560675

传真:010-68560661

网址:www.cebbank.com

(10)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:吴杰

电话:010-58560666

传真:010-83914283

网址:www.cmbc.com.cn

(11)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

法人代表: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

(12)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:021-62126969

传真:021-62521689

联系人:吴海平,翁敏芬

客服电话:021-962999

网址:www.shrcb.com

(13)长城证券有限责任公司

办公地址: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:高峰

电话:0755-83516094

传真:0755-83516199

网址:www.cc168.com.cn

(14)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

(15)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:上海市延平路135号

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

(16)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:010-65186080

网址:www.csc108.com

(17)国信证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

客服电话:800-810-8868

联系人:林建闽

电话:0755-82130833-2181

传真:0755-82133302

网址:www.guosen.com.cn

(18)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

(19)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

(20)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:肖时庆

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

(21)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:马韶明

客服电话:400-8888-555

联系人:范雪玲

电话:0755-82492190

传真:0755-82492962

网址:www.lhzq.com

(22)山西证券有限责任公司

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:吴晋安

客服电话:0351-8686868

联系人:张治国

电话:0351-8686703

传真:0351-8686709

网址:www.i618.com.cn

(23)申银万国证券股份有限公司

通讯地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

客服电话:021-962505

联系人:孙洪喜

电话:021-54033888

传真:021-54038844

网址:www.sw2000.com.cn

(24)海通证券股份有限公司

通讯地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

客服电话:021-962503

联系人:金芸

电话:021-53594566-4125

传真:021-53858549

网址:www.htsec.com

(25)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

联系人:陈忠

电话:010-84864818-63266

传真:010-84865560

网址:www.cs.ecitic.com

(26)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:020—96210

联系人:张茜萍

电话:0755-82825555

传真:0755-82558003

网址:www.essences.com.cn

(27)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15楼

法定代表人:徐浩明

客服电话:10108998

联系人:刘晨

电话:021-68816000

传真:021-68817271

网址:www.ebscn.com

(28)中信万通证券股份有限公司

注册地址: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:陈向东

电话:0532-85022026

传真:0532-85022511

网址:www.wtzq.com.cn

(29)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:龙海

电话:021-50588876

传真:021-50586660-8880

网址:www.longone.com.cn

(30)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

(31)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

开放式基金咨询电话:0571-96598

开放式基金业务传真:0571-85783771

联系人:王勤

联系电话:0571-85783715

网址:www.96598.com.cn

(32)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

(33)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:陈就明

客服电话:961130

联系人:张建平

电话:0769-22119423

传真:0769-22119423

网址:www.dgzq.com.cn

(34)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

(35)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

(36)华林证券有限责任公司

办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼

法定代表人:姚桥盛

客服电话:0750—3160388

联系人:杨玲

电话:0755-82707855

传真:0755-82707850

网址:www.chinalions.com

(37)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

法定代表人:陈学荣

客服电话:400-888-1551

联系人:杜颖灏

电话:021-68634518

传真:021-50543470

网址:www.xcsc.com

(38)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:0551—95888

联系人:程维

电话:0551-2634400

传真:0551-2645709

网址:www.gyzq.com.cn

(39)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市九江路111号

法定代表人:蒋元真

客服电话:021-962518

联系人:谢秀峰

电话:021-65076608-557

传真:021-65081063

网址:www.962518.com

(40)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:0551-5161671

联系人:唐泳

电话:0551-5161671

传真:0551-5161672

网址:www.huaans.com.cn

(41)兴业证券股份有限公司

注册地址:福建福州市湖东路99号标力大厦

办公地址:上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦18层

法人代表:兰荣

客服电话:021-68419393-1259

传真:021-68419867

网址:www.xyzq.com.cn

(42)财通证券经纪有限责任公司

法人代表:沈继宁

公司地址:杭州市解放路111号

客服电话:96336

联系人:乔骏

电话:0571-87925129

传真:0571-87925129

网址:www.ctsec.com

(43)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:400-8888-198

联系人:舒萌菲

电话:025-84784765

传真:025-84784830

网址:www.thope.com

电子邮箱:xtzqbgs@thope.com

(44)东方证券股份有限公司

住所:上海市浦东大道720号20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

(45)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

电话:0771-5539262

传真:0771-5539033

网址:www.ghzq.com.cn

(46)金元证券有限责任公司

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:金春

传真:0755-83025625

网址:www.jyzq.cn

(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

客服电话:0571-87902079

联系人:吴颖

电话:0571-87901963

传真:0571-87902081

网址:www.stocke.com

(48)渤海证券有限责任公司

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:022-28455588

联系人:王兆权

电话:(022)28451861

传真:(022)28451892

客服电话:28455588

网址:www.bhzq.com

(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:胡学光

电话:0755-83183388

传真:0755-83195239

联系人:范瑛、许韬略

(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)61238888

传真:(021)61238800

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。

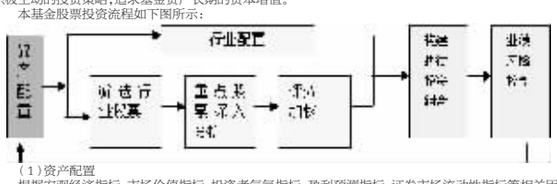
八、基金的投资范围

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2008年3月31日)

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,保证本报告所载内容不存在虚假记录、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,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2008年3月31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

| 项目 | 金额(元) | 占基金资产总值比例 |
|---|---|---|
| 股票 | 3,407,746,855.63 | 73.70% |
| 债券 | 101,968,816.90 | 2.21% |
| 权证 | 0.00 | 0.00% |
| 资产支持证券 | 0.00 | 0.00% |
| 银行存款和清算备付金合计 | 1,112,084,136.08 | 24.05% |
| 其他资产 | 1,833,220.88 | 0.04% |
| 合计 | 4,623,633,029.49 | 100.00% |

(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、渔业 | 0.00 | 0.00% |
| B 采掘业 | 277,481,115.86 | 6.07% |
| C 制造业 | 1,740,520,181.53 | 38.09% |
| C0 食品、饮料 | 128,488,713.35 | 2.81% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 62,532,418.35 | 1.37% |
| C2 木材、家具 | 0.00 