大成策略回报股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 日

基金管理人:大成基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2011年8月27日

§1 重要提示

1.1 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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司(以下简称“中国光大银行”)根据本基金合同规定,于2011年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成策略回报股票
基金主代码	090007
交易代码	090007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月26日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,677,586,684.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期稳健增值,兼顾当期收益;同时,实施积极的分红政策,回报投资者。
投资策略	本基金在控制风险的前提下,采取趋势投资策略进行总体资产配置;在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心—卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略,以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益;同时,强调收益管理,实施收益管理策略,以期在增长期及时锁定收益,制度性地减少未来可能的下跌风险,增加投资总收益。
业绩比较基准	80%×沪深300 指数+20%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于中高风险收益水平的股票型基金品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	石立平
	联系电话	0755-83183388	010-63639161
	电子邮箱	dupeng@defund.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008885558	95595
传真		0755-83199588	010-63639132

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.defund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层 大成基金管理有限公司 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心B座801 中国光大银行投资与托管业务部

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	56,202,005.68
本期利润	-104,538,760.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0585
本期基金份额净值增长率	-5.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0571
期末基金资产净值	1,834,522,368.21
期末基金份额净值	1.094

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

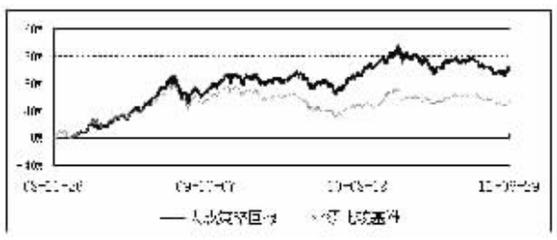
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.99%	1.08%	1.13%	0.96%	2.86%	0.12%
过去三个月	-3.53%	1.00%	-4.32%	0.88%	0.79%	0.12%
过去六个月	-5.22%	1.18%	-1.76%	0.99%	-3.46%	0.19%
过去一年	19.85%	1.29%	15.28%	1.13%	4.57%	0.16%
自基金合同生效起至今	103.89%	1.48%	53.46%	1.41%	50.42%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金已完成建仓。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托投资有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2011年6月30日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金、1只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40ETF及大成深证成长40ETF联接基金、1只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金、1只QDII基金:大成标普500等权重指数基金及17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(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、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金和大成内需增长股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周建春先生	本基金基金经理	2008年11月26日	--	13年	管理工程硕士。1998年1月—1999年9月,任职于湖南省国际信托投资公司基金管理部,证券管理总部,从事投资和研究工作;1999年10月加入大成基金管理有限公司,历任高级研究员、景博证券投资基金经理助理、景博证券投资基金基金经理(2002年1月11日—2004年3月31日)、景福证券投资基金经理助理。2008年11月26日起担任大成策略回报股票型基金基金经理。2009年9月24日起兼任大成积极成长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。
刘洋女士	本基金基金经理助理	2009年10月12日	--	3年	工商管理硕士,2007年7月加入大成基金管理有限公司从事研究工作,现任行业研究员。2009年10月起同时担任本基金和大成积极成长股票型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍:中国。

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成策略回报股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成策略回报股票型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、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,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》,公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5日内、10日内)同向、反向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据各基金合同,目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011上半年全球发达经济体的复苏出现波折,美国第二轮量化宽松即将结束,但失业率仍居高不下,二季度经济数据显著低于市场预期;欧洲主权债务危机再次显现,日本脆弱的经济复苏形势受核电事故影响更加严峻;而新兴经济体普遍受制于较高的通货膨胀水平,导致这些国家更早地采取紧缩的宏观经济政策。今年以来我国政府为了控制通胀水平、加强房地产价格调控、促进经济转型,也持续出台了一系列宏观调控政策,因此经济增长也出现一定程度放缓的迹象。

上半年证券市场受制于通胀环境下紧缩政策的压制,企业盈利开始出现下调,市场的估值水平不断下移。一季度低估值蓝筹股表现好于高估值的中小板和创业板,去年涨幅较大的食品饮料、医药、TMT行业表现较差;二季度消费板块和中游制造业表现较好,其中工程机械、水泥和家电表现突出。上半年本基金一直维持较高股票仓位比例,第一季度大幅减持了食品饮料和消费行业,适当增加了金融地产、煤炭、汽车等行业的配置比例,行业配置相对均衡,目前来看这种转换的效果其实并不明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.094元,本报告期份额净值增长率为-5.22%,同期业绩比较基准增长率为-1.76%,低于同期业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,欧洲主权债务危机将因为欧盟内部救助获得平息,美国经济没有明显复苏,仍将维持较为宽松政策以刺激经济复苏。国内宏观经济硬着陆风险较小,通胀压力依然存在,猪肉和粮食价格持续上涨将对未来通胀形成压力,但处于可控状态,预计物价指数最迟7月份见顶后缓慢回落,紧缩政策接近尾声,未来2-3个月政策进入观察期。从全年角度看经济不会出现大的波动,消费增速略有下滑但无需担忧,投资增速不会快速回落,四季度保障房拉动作用明显,短期经济回落只是暂时的,如果三季度末经济明显回落,预期政策可能松动,但很难出现实质性的放松。

展望证券市场,未来进一步紧缩政策已经被市场预期并反映,市场整体估值水平较低,指数下跌空间有限,但是短期政策方向也难以出现逆转,预计市场可能进入探底和形成底部的阶段。在资产配置上,我们继续保持较高股票仓位;在行业配置方面,由于紧缩政策短期难以放松,流动性制约市场向上发展空间,预计未来市场主要来自于结构性投资机会,我们重点关注三个方面:一是受益于保障房建设的工程机械和水泥等行业,二是受益于产业结构调整的新兴产业,三是长期看好资源品和消费品的投资价值。我们将选择估值合理、业绩增长较为确定的行业及龙头公司作为主要投资标的,加强自下而上的选股能力,努力把握周期性行业阶段性投资机会,力争获取良好的收益水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会,公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益部、金融工程部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会8名成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、固定收益部、金融工程部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态,评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量;定期对估值政策和程序进行评价,以保证其持续适用;基金运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,并负责与托管行沟通估值调整事项;监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理及投资经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期末本基金可供分配收益为95,750,644.08元,本基金的基金管理人已于2011年1月13日公告分红,以截至2010年12月31日可供分配收益为基准,向截至2011年1月17日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发现金红利0.44元,符合基金合同规定的分红比例。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年上半年,中国光大银行在大成策略回报股票型证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对大成策略回报股票型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年,中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——大成基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对基金管理人——大成基金管理有限公司编制的“大成策略回报股票型证券投资基金2011年半年度报告”进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

中国光大银行投资与托管业务部

2011年8月25日

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:大成策略回报股票型证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	305,659,186.35	368,255,633.34
结算备付金	222,268.59	6,738,944.91
存出保证金	1,522,912.40	1,375,596.41
交易性金融资产	1,552,177,391.77	2,061,111,590.20
其中:股票投资	1,552,177,391.77	2,056,818,241.18
基金投资	-	-
债券投资	-	4,293,349.02
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	54,718.78	68,567.18
应收股利	672,000.00	-
应收申购款	4,253,467.55	3,838,869.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,864,561,945.44	2,441,389,201.44
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	23,913,126.70	11,202,865.89
应付赎回款	1,848,571.50	737,757.20
应付管理人报酬	2,178,516.51	2,828,944.00
应付托管费	363,086.12	471,490.63
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,283,874.54	4,308,593.44
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	452,401.86	352,207.37
负债合计	30,039,577.23	19,901,858.53
所有者权益:		
实收基金	1,677,586,684.24	2,017,888,903.81
未分配利润	156,935,683.97	403,598,439.10
所有者权益合计	1,834,522,368.21	2,421,487,342.91
负债和所有者权益总计	1,864,561,945.44	2,441,389,201.44

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.094元,基金份额总额1,677,586,684.24份。

6.2 利润表

会计主体:大成策略回报股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日 至 2011年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入	-82,137,951.02	-145,524,960.99
1.利息收入	958,634.46	777,205.31
其中:存款利息收入	951,255.18	775,443.46
债券利息收入	7,379.28	1,761.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	76,612,708.54	-47,953,646.37
其中:股票投资收益	66,823,423.22	-51,386,838.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,030,422.96	21,879.35
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,758,862.36	3,411,312.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-160,740,765.91	-98,793,344.93
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,031,471.89	444,825.00
减:二、费用	22,400,809.21	14,698,532.21
1.管理人报酬	14,894,463.21	9,565,548.70
2.托管费	2,482,410.57	1,594,258.06
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,816,579.34	3,353,684.85
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	207,356.09	185,040.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-104,538,760.23	-160,223,493.20
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-104,538,760.23	-160,223,493.20

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成策略回报股票型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日 至 2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,017,888,903.81	403,598,439.10	2,421,487,342.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-104,538,760.23	-104,538,760.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-340,302,219.57	-54,175,627.58	-394,477,847.15
其中:1.基金申购款	521,663,918.77	63,494,509.81	585,158,428.58
2.基金赎回款	-861,966,138.34	-117,670,137.39	-979,636,275.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-87,948,367.32	-87,948,367.32
五、期末所有者权益(基金净值)	1,677,586,684.24	156,935,683.97	1,834,522,368.21
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,088,457,457.37	77,670,853.27	1,166,128,310.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-160,223,493.20	-160,223,493.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	432,873,991.06	5,405,994.01	438,279,985.07
其中:1.基金申购款	776,786,963.90	23,229,895.02	800,016,858.92
2.基金赎回款	-343,912,972.84	-17,823,901.01	-361,736,873.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,521,331,448.43	-77,146,645.92	1,444,184,802.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:王颖　　主管会计工作负责人:刘彩晖　　会计机构负责人:范瑛

6.4 报表附注

6.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”)	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东

注:1. 中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.3.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,894,463.21	9,565,548.70
其中:支付销售机构的客户维护费	1,877,843.16	1,601,509.15

注:支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,482,410.57	1,594,258.06

注:支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日(2008年11月26日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	30,001,666.72	30,001,666.72
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	30,001,666.72	-
期末持有的基金份额	-	30,001,666.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.97%

注:基金管理人赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	305,659,186.35	918,799.50	343,836,422.44	750,090.73

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,按约定利率计息。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.4 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.4.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600703	三安光电	10/10/15	11/10/13	非公开发行	13.64	15.61	1,100,000	15,000,000.00	17,171,000.00	-

注:1.基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

2. 上述“三安光电”股票认购价格及数量与2010年年度报告相比发生变动的原因是该股票于本报告期内进行了利润分配。

3.上述部分股票的可流通日期系根据上市公司的相关公告推算得出,具体可流通日期以上市公司后续公告为准。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	10/12/6	重大事项	35.60	未知	未知	1,399,945.00	50,903,485.91	49,838,042.00	-

注:本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本报告期末本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,552,177,391.77	83.25
	其中:股票	1,552,177,391.77	83.25
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	305,881,454.94	16.41
6	其他各项资产	6,503,098.73	0.35
7	合计	1,864,561,945.44	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,760,000.00	0.26
B	采掘业	198,049,771.97	10.80
C	制造业	979,522,067.17	53.39
C0	食品、饮料	220,917,610.72	12.04
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	127,084,160.00	6.93
C5	电子	23,145,000.00	1.26
C6	金属、非金属	142,109,070.07	7.75
C7	机械、设备、仪表	385,888,226.38	21.03
C8	医药、生物制品	80,378,000.00	4.38
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	84,142,783.96	4.59
H	批发和零售贸易	45,064,707.59	2.46
I	金融、保险业	148,606,200.00	8.10
J	房地产业	84,887,400.00	4.63
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	7,144,461.08	0.39
	合计	1,552,177,391.77	84.61

7.3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投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	6,694,838	120,774,877.52	6.58
2	000937	冀中能源	2,750,000	69,712,500.00	3.80
3	601318	中国平安	1,300,000	62,751,000.00	3.42
4	000858	五 粮 液	1,600,000	57,152,000.00	3.12
5	000338	潍柴动力	1,199,929	54,512,774.47	2.97
6	600406	国电南瑞	1,500,000	54,450,000.00	2.97
7	601699	潞安环能	1,600,000	52,496,000.00	2.86
8	000538	云南白药	900,000	51,372,000.00	2.80
9	600887	伊利股份	3,000,000	49,950,000.00	2.72
10	600315	上海家化	1,399,945	49,838,042.00	2.72

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.defund.com.cn)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	89,974,977.02	3.72
2	000937	冀中能源	89,967,958.41	3.72
3	000338	潍柴动力	82,581,954.64	3.41
4	601166	兴业银行	66,461,013.89	2.74
5	600406	国电南瑞	61,969,955.84	2.56
6	601699	潞安环能	61,483,215.71	2.54
7	601088	中国神华	54,182,104.69	2.24
8	000858	五 粮 液	53,424,819.34	2.21
9	600557	康缘药业	43,808,437.39	1.81
10	000157	中联重科	39,363,804.98	1.63
11	002024	苏宁电器	38,951,859.14	1.61
12	002121	科陆电子	36,453,939.18	1.51
13	000063	中兴通讯	33,267,089.92	1.37
14	600418	江淮汽车	30,729,229.80	1.27
15	000651	格力电器	29,923,412.44	1.24
16	600585	海螺水泥	27,774,529.86	1.15
17	600425	青松建化	27,418,822.99	1.13
18	600660	福耀玻璃	27,026,655.71	1.12
19	601717	郑煤机	24,261,198.06	1.00
20	600016	民生银行	24,096,465.22	1.00

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000895	双汇发展	85,850,728.32	3.55
2	000423	东阿阿胶	78,098,614.37	3.23
3	601166	兴业银行	69,284,463.42	2.86
4	000848	承德露露	66,346,897.03	2.74
5	600267	海正药业	62,045,176.75	2.56
6	002024	苏宁电器	59,355,453.95