金额单位:人民币元

### 基金管理人:大成基金管理有限公司

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 性和完整性系化的现在分类。 世和完整性系化列队是菲特的建肃任。本半年度据告已经了分之口以上如立董事签字同意,并由董事长签发。 基金托管人中国农业银行股份有限公司《以下简称 中国农业银行"根据本基金合同规定,于2011年8月19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影记载,误导性

204百里人及閩西。 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失其未来表现。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更新。 本半年度报告摘契据自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告财务资料表金审片。

平板百购分页杆小公平时。 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	大成积极成长股票
基金主代码	519017
基金交易代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月16日
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
报告期末基金份额总额	2,925,510,954.93 份
基金合同存续期	不定期

在优化组合投资基础上,主要投资于有良好成长潜力的上市公司,尽可能规避投资风险,谋求基金财产长期增值。
本基金主要根据 GDP 增长率、工业增加值金化率、固定资产经营结 参A 最市场平均市 海半及其金化益势,真实工率,外驾顺差,指 价格指数 CDP 增长率 M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政 策的变化、对宏观经济发证者市场的总体变动趋势进行定量、定性分析 "作出资产量固定资"本参应公力争通过的分据分析,放生型研 选。估值比较、实地调听等深入。科学的基本面分析,挖掘具有良好成 长性的上市公司进行投资。
沪深 300 指数×80%+中证综合债券指数×20%
本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司,属于中高风险的证券投资基金品种。

∃	基金管理人	基金托管人	
	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
姓名	杜鹏	李芳菲	
联系电话	0755-83183388	010-66060069	
电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com	
	4008885558	95599	
	0755-83199588	010-63201816	
	姓名 联系电话	大成基金管理有限公司           姓名         杜鹏           联系电话         0755-83183388           电子邮箱         dupeng@defund.com.cn           4008885558         4008885558	

2.4 信息披露万式	
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.defund.com.en
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 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贺中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部
	80 主要财务指标和其会条值事项

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	124,671,962.03
本期利润	-177,058,597.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0608
本期基金份额净值增长率	-5.49%
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	0.0416
期末基金资产净值	3,047,121,680.43
期末基金份额净值	1.042

中河山 大學以益即工 年期公允价值变动收益。 2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人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 份额净值增长 业绩比较基准 收益率标准差 (D-3) (2-4)							
好侧手但增长 率①	率标准差②	业项比较基准 收益率3	收益率标准差 ④	1)-3)	2-4		
3.89%	1.10%	1.09%	0.96%	2.80%	0.14%		
-3.96%	1.04%	-4.27%	0.88%	0.31%	0.16%		
-5.49%	1.19%	-1.74%	0.99%	-3.75%	0.20%		
20.51%	1.31%	15.37%	1.13%	5.14%	0.18%		
33.48%	1.65%	10.48%	1.63%	23.00%	0.02%		
69.30%	1.81%	22.99%	1.77%	46.31%	0.04%		
	<b>分額争值増长率①</b> 3.89% -3.96% -5.49% 20.51% 33.48%	分额争值增长	り額净值増长 け郷净值増长 业绩比较基准 率① 3.89% 1.10% 1.09% -3.96% 1.04% -4.27% -5.49% 1.19% 1.17% 20.51% 1.31% 15.37% 33.48% 1.65% 10.48%	り 物	り物率値増长		

DY-01-16 07-10-11 08-07-05 09-01-10 09-12-21 10-09-14 11-04-17 一大成製板或板投稿 如據此級亦進

在11.仅然整查目的现在人况的税据次取录至证券投资资金日查验目查验目的上次。日本3个月7个为建立物。 舰王建立物自制,未基金的2和投资代间之为基金合同中规定的比例。
2.本基金业绩比较基准自 2009 年 2 月 2 日起变更为: 沪深 300 指数×80% 中证综合债券指数×20%。 本基金业绩比较基础这章的历史非常别从 2007 年 月 月 15 假金合同性火蟹基金种银 日至 2009 年 2 月 1 日为原业绩比较基准 衡年密时 600 成长指数收益率×80% 新年留费中国全债指数收益率×20% 新走势图 2 2009 年 2 月 2 日起为变更后的业绩比较基准的走

## §4 管理人报告

4.1.2 基金经理 (成基金经理小组)及基金经理助理简介

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 4.1. 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 [999] 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。注册绝为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中塞信托投 资有限责任公司 48%, 3 光、证券股份有限公司 55%。)中国银河投资管理有限公司 55%。)厂东证券股份有限公司 55%。 2 2011年 6 月 30 日、本基金管理人共管理 3 2时相对证券投资效金。景宏证券投资基金。是证券投资基金。人成股金股票 型证券投资基金。1 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金;深证成长 40ETF 联接基金。1 只创新型基金;大成贵 手分级债券型证券投资基金,1 只 QDI 基金;大成标》等 500 等以里指数基金及 17 只开放大证券投资基金,大成价值增长证券 投资基金、大成债券付款分量。大成营等海链产投资基金、大成货币当的证券投资基金 金、大成分产。300 指数证券投资基金、大成货币当的证券投资基金。大成货币当的证券投资基金 金、大成分产。300 指数证券投资基金。人或货币当的证券投资基金、发现货币当的证券投资基金。大成货币自然企业 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

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	2009年 9 月 24日	-	13年	管理工程额世、1998年1月—1999年9月,任 即于湖南省国际信托党公公司基金管理影。 参管理总部、从果均馀和研究工作。1999年10 月加入大或基金管理看限公司,历任高级研究 员、崇神证券投资基金经理助理。崇博证券投资 基金基金经理。2002年1月11日—2004年3 月31日),第61年3月25年3日,第61年3月3日, 年11月26日起赶大戏策略即披展课型基金 基金经理。2009年9月24日建新士大级策略 度1月26日或胜于大级策略的披展课型基金 金金经理。2009年9月24日建新士大级联格 成长股票型证券投资基金基金经理。2004年3 加速等处置。
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月加人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.任职目期,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递从行业协会 任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产储建划宇信陆宏的说明 本报告期内,本基金管理人严格遵守 任券法》、任券投资基金法》、伏成积极成长股票型证券投资基金基金合同)和其

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 并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 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 

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 成创新成长混合型证券投资基金

44.1 核百期付益或欠效率的构造下7701 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;战州主使债务危机再次型现,日本能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

了较高的进成现状不。等以这些国家是平地未取养殖的宏观经验放弃。今年从来农园政府为了经初进底水平。加强历泡的价格阅读。促进经济转型。也持续出台了一条初宏观国际政策。 上半年证券市场受割于通胀环境下紧缩贬策的压制。企业盈利开始出现下国,市场的估值水平不断下移。一季度账估值 监察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类现较好,其中工程机械、水泥和家电表现实出。上半年本基金一直维持较高极黑仓位比例,第一季度大幅或排了仓品饮料、拓背费行业,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

截至报告期末,本基金份额争值为1.042元,本报告期份额争值增长率为-5.49%,同期业绩比较基准增长率为-1.74%,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,成州主使传统和报告为资理的解散助获得平息,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。国内宏观经济便着陆风险较小,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

状态、纳计物价指数成数2 7 月份规则后级慢回落。紧缩放策按近尾声、未来 2-3 个月放棄进入观察期。必全半期度看经济不会 出现大的波动、消费增速解存了滞但无需担仗、投资增越不会快速回客、四等缓保障身拉动作用明显、短期经济回客只是暂时 的、如果三季度未经济明显回落,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 方向也难以出现建转,预计市场印能进入探底积形成能部阶段。在资产配置上,我们继续保持较高股票仓伍。在行业配置方 面,由于紧缩政策短期难以放松。流动性邮份市场间上及恢定间,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决定等行业。二是受益于产业结构调整的解决产业。三是长期看好资源品和消 排足的结构等价值、我们依许是依任会用。通常经验较分离价等行限。专业公司等企业主理投资价值、对值不是必需的 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 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

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。

程平的风险控制,开页贯信值调整事项的信息披露工作。 本基金的日常信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。基金信值政策的议定和 核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。

本基金管理人門核医斯特德基金基金信息的规定进行收益分配。本报告期末本基金可供分配收益为121.610,725.50元,本基金已于2011年1月17日公告以截至2010年12月31日可供分配收益为基准,向本基金份额持有人进行收益分配.每10 份基金份额派发现金红利 0.6100 元,符合基金合同规定

§5 托管人报告

E托管大成积极成长股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基 金法》相关法律法规的规定以及《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》、《大成积极成长股票型证券投资基金托管协

# 大成积极成长股票型证券投资基金

## 2011 半年度 报告摘要

### 2011年6月30日

议》的约定,对大成积极成长股票型证券投资基金管理人一大成基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督;认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有

人利益的行为。 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

5.2 仟電人对报告期内本基金投资运作遗址守信,净值计算。利润分配等情况的说明 本托管人认为,大成基金管理有限公司在大成积极成长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份 额申购赎回价格的计算。基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金价额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守 了 证券投资基金法等有关法律法规。在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。 5.3 仟管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事多符合。征券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的 规定,基金管理人所编制和披露的大成积极或长股票业产券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的 规定,基金管理人所编制和披露的大成积极或长股票业产券投资基金信息中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财 务会计报告人投资组合报告等信息真实。准确、完整、未发现有很害基金持有人利益的行为。 6.1 资产负债表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

资产	本期末	上年度末
资产:	2011年 6 月 30 日	2010年 12 月 31 日
银行存款	525,331,313.92	473,160,024.
### 結算备付金	509,563.73	11,060,451
存出保证金	2,560,848.25	
	2,560,848.25	2,162,779. 2,945,263,404.
交易性金融资产 其中:股票投资		
	2,572,988,591.17	2,938,254,883
基金投资	-	7 000 520
债券投资	-	7,008,520
资产支持证券投资	-	
衍生金融资产	-	
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	-	39,356,623
应收利息	79,054.68	88,571
应收股利	1,176,000.00	
应收申购款	279,872.82	449,630
递延所得税资产	-	
其他资产	2,884,512.64	2,884,512
资产总计	3,105,809,757.21	3,474,425,996
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	49,028,609.34	5,020,944
应付赎回款	941,523.38	629,366
应付管理人报酬	3,555,327.52	4,210,296
应付托管费	592,554.60	701,716
应付销售服务费	-	
应付交易费用	685,812.49	9,366,763
应交税费	-	236,858
应付利息	-	
应付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	3,884,249.45	3,785,675
负债合计	58,688,076,78	23,951,621
所有者权益:		
实收基金	2,925,510,954.93	2,955,243,574
未分配利润	121,610,725,50	495,230,801
所有者权益合计	3,047,121,680.43	3,450,474,375
负债和所有者权益总计	3,105,809,757.21	3,474,425,996

6.2 平胡马秋 会计主体:大成积极成长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

项目

1,470,196.45 1,293,829,41 1,466,672.56 3,523.89 11,932.8 人返售金融资 139,894,323.5 1,647,693.5

本期 2011年1月1日至2011年6月

上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月

-10,119,329.22 13,071.81 工具收益 14,887,629.4 6,344,454.0 -301,730,559.0 -309,684,697.20 二兑收益 假失以 ""号填列 其他收入 假失以 ""号填列 33,163,152.85 32,619,220.34 23,166,557.4 21,345,965.68 销售服务费 交易费用 5,918,086.5 7,501,095.74 -177,058,597.06 -344,537,020.71 四、净利润(净亏损以""号填列) -344,537,020.71 -177,058,597.06

会计主体:大成积极成长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

			単位:人民市の	
项目	2011 <sup>±</sup>	本期 F1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)	2,955,243,574.25	495,230,801.17	3,450,474,375.42	
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	-177,058,597.06	-177,058,597.06	
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)	-29,732,619.32	-16,758,291.41	-46,490,910.73	
其中:1.基金申购款	222,362,577.24	5,017,894.56	227,380,471.80	
2.基金赎回款	-252,095,196.56	-21,776,185.97	-273,871,382.53	
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)	-	-179,803,187.20	-179,803,187.20	
五、期末所有者权益 (基金净 值)	2,925,510,954.93	121,610,725.50	3,047,121,680.43	
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)	3,061,325,526.08	123,084,164.97	3,184,409,691.05	
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	-344,537,020.71	-344,537,020.71	
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)	-245,260,774.33	108,069.43	-245,152,704.90	
其中:1.基金申购款	49,230,404.05	-662,012.98	48,568,391.07	
2.基金赎回款	-294,491,178.38	770,082.41	-293,721,095.97	
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)	-	-15,078,299.88	-15,078,299.88	
五、期末所有者权益 (基金净 值)	2,816,064,751.75	-236,423,086.19	2,579,641,665.56	

\_\_\_\_\_ XU#VIFF \_\_\_\_\_ 主管会计工作负责人

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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 本基金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。

TIND THE TIND THE WALL OF CONTROL					
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、基金销售机构				
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行")	基金托管人、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				
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

0.4.3.1.1 及示	200			金额单位:人民币5
	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	
关联方名称	成交金額	占当期股票 成交总额的比 例	成交金額	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	85,867,746.13	2.24%	641,965,567.92	13.52%

6.4.3.1.2 债券交易 本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。 6.4.3.1.3 债券回购交易 本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

关联方名称		2011年1月1日	本期 3至 2011 年 6 月 30 日	
大联刀石桥	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	72,135.20	2.26%	18,468.76	2.69%
关联方名称		上年 2010年 1 月 1 日	度可比期间 3至 2010 年 6 月 30 日	
大联万石桥	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
光大证券	521.602.08	13.13%	2,635,075.28	38 69%

注:1、上途佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.3.2.1 基金管理费

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	23,166,557.40	21,345,965.68			
其中:支付销售机构的客户维护 费	4,047,893.68	3,837,068.92			
V. AZIAKA MARIELI ANDA MAMAREL PRINCIPAL PRINCIPAL AND					

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。

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%年天数。

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	3,861,092.90	3,557,660.9			
注:支付基金托管人中国农业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,					

日托管费=前一日基金资产净值x0.25%年天数。 6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 侩回购)交易

本基金本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券或回购交易。 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

		7万40年117.
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 (2007年1月16 日) 持有的基金份额	-	
期初持有的基金份额	34,573,260.00	34,573,260.0
期间申购买人总份额	-	
期间因拆分变动份额	-	
减:期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	34,573,260.00	34,573,260.0
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.18%	1.239

注:基金管理人申购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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金。 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 20	011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		
4000	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国农业银行	525,331,313.92	1,260,087.20	497,166,844.85	1,439,242.	
注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管、按银行同业利率计算。					

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本期内未在承销期内参与关联方承销证券。

本基金本报告期无其他关联交易事项说明

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

可流通日 期末估值总额

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、根据是每与上市公司所签订单购协议的规定。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、三安光电 600703 认购价格及数量与2010年年度报告相比发生变动的原因是上述股票于2011年上半年进行了利润

									金额单位:人	机
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 段)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010年 12月6 日	资产重组	35.60	未知	未知	2,199,855	79,916,188.06	78,314,838.00	-

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

§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	2,572,988,591.17	82.84
	其中:股票	2,572,988,591.17	82.84
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	买人返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	525,840,877.65	16.93
6	其他各项资产	6,980,288.39	0.22
7	合计	3,105,809,757.21	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 66)
Α	农、林、牧、渔业	7,140,000.00	0.23
В	采掘业	338,076,792.11	11.09
С	制造业	1,594,401,424.83	52.32
C0	食品、饮料	379,346,190.48	12.45
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	221,247,516.36	7.26
C5	电子	41,657,451.10	1.3
C6	金属、非金属	226,876,245.65	7.4:
C7	机械、设备、仪表	604,798,532.83	19.85
C8	医药、生物制品	120,475,488.41	3.95
C99	其他制造业	_	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
Е	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	_	0.00
G	信息技术业	146,680,681.96	4.8
Н	批发和零售贸易	66,744,299.72	2.19
I	金融、保险业	261,661,317.60	8.59
J	房地产业	147,841,684.11	4.85
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	10,442,390.84	0.34
	合计	2,572,988,591.17	84.44

7.3 男	1木按公元1771日	白基金分产净值区	例大小排序的則十名股票形	EYSERHEIH	
					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量 (段)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600031	三一重工	11,686,257	210,820,076.28	6.92
2	000937	冀中能源	4,800,000	121,680,000.00	3.99
3	601318	中国平安	2,500,000	120,675,000.00	3.96
4	000338	潍柴动力	2,200,000	99,946,000.00	3.28
5	000568	泸州老窖	2,100,427	94,771,266.24	3.11
6	600406	国电南瑞	2,599,572	94,364,463.60	3.10
7	601699	潞安环能	2,800,000	91,868,000.00	3.01
8	600887	伊利股份	5,400,000	89,910,000.00	2.95
9	000858	五粮液	2,399,987	85,727,535.64	2.81
10	000538	云南白药	1,400,000	79,912,000.00	2.62

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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.en 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 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

占期初基金资产净值比例 %)	本期累计买人金额	股票名称	股票代码	序号
3.5	122,548,524.52	三一重工	600031	1
3.5	120,637,197.04	冀中能源	000937	2
3.3	116,931,294.52	潍柴动力	000338	3
2.7	93,221,230.43	潞安环能	601699	4
2.5	88,601,357.32	国电南瑞	600406	5
2.3	79,620,506.09	五 粮 液	000858	6
2.1	74,208,335.59	中国神华	601088	7
1.9	68,296,226.58	兴业银行	601166	8
1.9	67,382,560.25	康缘药业	600557	9
1.7	58,517,937.29	中兴通讯	000063	10
1.5	54,963,924.97	苏宁电器	002024	11
1.5	52,685,069.90	格力电器	000651	12
1.4	50,382,206.84	科陆电子	002121	13
1.4	48,556,236.10	中联重科	000157	14
1.3	46,725,545.01	海螺水泥	600585	15
1.1	41,188,459.10	锡业股份	000960	16
1.0	36,769,957.20	福耀玻璃	600660	17
1.0	34,943,053.92	中国南车	601766	18
1.0	34,806,110.96	民生银行	600016	19
1.0	34,613,478.19	青松建化	600425	20

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

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	000423	东阿阿胶	139,779,533.67	4.05
2	002024	苏宁电器	114,602,463.73	3.32
3	000895	双汇发展	109,420,050.20	3.17
4	000848	承德露露	106,830,231.77	3.10
5	600079	人福医药	91,261,127.66	2.64
6	600267	海正药业	83,163,205.35	2.41
7	600703	三安光电	81,735,956.54	2.37
8	601166	兴业银行	73,283,849.97	2.12
9	601717	郑煤机	73,031,285.61	2.12
10	000527	美的电器	72,232,997.01	2.09
11	601111	中国国航	69,551,001.36	2.02
12	000962	东方钽业	64,070,291.99	1.86
13	600557	康缘药业	61,795,171.14	1.79
14	600858	银座股份	58,904,492.57	1.71
15	600600	青岛啤酒	55,210,591.65	1.60
16	600467	好当家	54,677,106.48	1.58
17	000858	五粮液	54,267,293.33	1.57
18	000568	泸州老窖	53,242,954.72	1.54
19	000651	格力电器	47,980,270.70	1.39
20	600754	锦江股份	39,577,996.78	1.15

注:本期累计实出金额指实出成交金额 (域交单) 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总	
	单位:人民币元
《人股票成本 (成交 )总额	1,818,325,545.64
は出股票收入(成交)总额	2,023,057,523.13

注:上述金额均指成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。

本盘查本报告期本未符有倾穿。 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 本基金本报告期末未特有债券。 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

7.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查的。或在报告编制日前一年内受到公开谴责。外

2011年5月27日,本基金投资的前十名证券之一五粮液因信息披露违法被中国证券监督管理委员会罚款60万元。本基

单位:人民币元

2,560,848.25 1,176,000.00 79,054.68 279,872.82

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差

§8 基金份额持有人信息 81 期末基金份额持有人户数及持有人结构 持有人户数 (广

121,021	21,001.02	05075257515151	21.75%	2,20	7,105,111.02	70.2070
8.2 期末基金管	严理人的从业人员持	有本开放式基金的情况				
	项目		持有份额	i总数 (分)	占基金总	份额比例
基金管理公司所有	有从业人员持有本开	放式基金		3,639.33		0.000124%
		§9 开放式基金	份额变动			
						单位:他
基金合同生效日	(2007年1月16日	基金份额总额			50	0,000,000.00
***记生: 智用智用之口 甘之	\$40.96 in 96				2.05	5 242 574 25

222,362,577.2

2,925,510,954.9

本报告期期末基金份额总额

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

金额单位:人民币元

§10 重大事件揭示 报告期内无基金份额持有人大会决议

报告期内之金金貯御行有人欠会成以。
10.2 基金管理人、基金托管 的专门基金托管部门的重大人事变动
2011年1月21日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格 证监许可 [2011]
116号)、张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部成总组。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金任营业务的诉讼
本报告期内设有涉及本基金管理人、基金财产、基金任营业务的诉讼事项。
10.1 其实社员经验的发达法。

10.4 基金投资策略的改变 本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司、该事务所自基金合同生效日起为

基金建供申订服务至今。 106 管理人,指管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本据告期,本基金管理人,托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。 107.基金租用证券公司交易单元的有关情况 107.1.基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元 成交金额 佣金 896,730,046.1

券商名称 备注 835,113,950.9 减少2个交易单元 368,641,759,4 9.60% 299,525.1 9.37% 新増1个交易单元 192,792,492.8 156,644.7 136,284,774.7 115,842.5 113,556,136.56 105,898,301.46 85,867,746.13 2.24% 78,810,789.82 新増2个交易单元 63,933,026.5 新増1个交易单元 1.33% 新増1个交易单元 49,907,332. 42,421.30 新増1个交易单元 新増1个交易单元 6,642,649.2 5,646.23 0.18%海通证券 0.00% 新増1个交易单元 宏源证券 减少1个交易单元 新増1个交易单元 新増1个交易单元 新增1个交易单元 0.00% 新增1个交易单元 0.00% 新増1个交易单元 瑞银证券 新増1个交易单元 上海证券 0.00% 0.00% 新増1个交易单元

定、本公司院工程用证金工资间的 误了。还能证为这对效验证又创加证则以有不问应 定、本公司院工程用证券公司交易单元的选择标准电影。 租用证券公司交易单元的选择标准主要包括: (一新考书权良好、最近一年无重大速解行为; (二 签套行为规范,内控制度健全、能满足各投资组合运作的保密性要求;

伍 )能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

仨)研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务 (四)具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;

六)相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件 司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《价商服务评价表》,然后根据评分高低

租用证券公司父易毕元的程序:自先根据租用证券公司父易丰 宁选择基金交易单元。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投	1,989,840.60	17.74%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	9,228,293.50	82.26%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
宏源证券	-	0.00%	-	0.00%	_	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	_	0.00%
联合证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
由銀万国	_	0.00%	_	0.00%	_	0.00%

大成基金管理有限公司