8,111,869,675.91

0.00 0.00

3.60

信息披露 Disclosure

基金管理人:大成基金管理有限公司基金托管人:中国银行股份有限公司送出日期:2011年8月27日

送出日期:2011年8月27日

\$1 重要提示及目录
基金管理人的董事会、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存任。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。
基金在管人中国辖行股份有限公司《以下简称》中国银行"附据本基金合同规定"于 2011年8月24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、误寻性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承记以建实信用、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。
本半年度报告报逻辑自半年度报告正文、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。

2.1 基金基本情况 基金商称 大成蓝筹稳健混合 基金主代码 090003 前端交易代码 090003 后端交易代码 091003 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	本报告期自 2011年1月1日起至	
基金主代码 090003 前端交易代码 090003 后端交易代码 091003 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	2.1 基金基本情况	§2 基金简介
前端交易代码 090003 后端交易代码 091003 基金运作方式 契约型开放式 基金合作生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	基金简称	大成蓝筹稳健混合
后端交易代码 091003 基金运作方式 契約型开放式 基金合同生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	基金主代码	090003
基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	前端交易代码	090003
基金合同生效日 2004年6月3日 基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	后端交易代码	091003
基金管理人 大成基金管理有限公司 基金托管人 中国银行股份有限公司	基金运作方式	契约型开放式
基金托管人中国银行股份有限公司	基金合同生效日	2004年6月3日
	基金管理人	大成基金管理有限公司
担生和主甘入八姓兴姓 16 884 722 858 84//	基金托管人	中国银行股份有限公司
1以百別不至並仍拠心側 10,884,725,930.84万	报告期末基金份额总额	16,884,723,950.84份
基金合同存续期 不定期	基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	,
投资目标	通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券,在控制非系统风险的前提下获取投资收益,同时辅助运用一系列数量分析方法,有效控制系统性风险,实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略利用修正的恒定比例投资组合保险策略 CPPI)宋动态调整基金中股票、债券和现金的配置比例,行业 配置采取较为积极的策略。以投资基准的行业权更为基础。以 行业研究及比较分析为核心,通过适时增大或降低相应行业 的投资权宜,使整体投资基现跟上或超越投资基准。P股选择 策略则采用监筹成分股优选策略。运用 价值 势头"选股方 法、优选出被市场低估并有良好市场表现,处于价值回归阶段 的天相280指数成分股投资。
业绩比较基准	天相280指数×70%+中信标普国债指数×30%
风险收益特征	本基金属于较低风险证券投资基金,适于承受一定风险,追求 当期收益和长期资本增值的基金投资人。

		基金托管人
	C22 (88) P4 (188) T	
	大成基金官埋有限公司	中国银行股份有限公司
姓名	杜鹏	唐州徽
联系电话	0755-83183388	010-66594855
电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
	4008885558	95566
	0755-83199588	010-66594942
	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@dcfund.com.cn 4008885558

位 数基金丰平度	http://www.dcfund.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 北京市西城区复兴门内大街1号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部		
co 十两时久七行和甘命洛信主项			

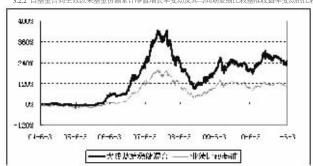
\$3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1 工安公司 妖酒中风力泪小	金额单位: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	-164,181,174.72
本期利润	-1,016,048,134.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0589
本期基金份额净值增长率	-6.89%
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	-0.3449
期末基金资产净值	13,513,471,848.19
期末基金份额净值	0.8003

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

3.2 基金净值表现 3.2 基金净值表现 3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额伊值增长率及共与问期业项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	4.53%	1.26%	0.84%	0.84%	3.69%	0.42%
过去三个月	-3.99%	1.09%	-3.82%	0.78%	-0.17%	0.31%
过去六个月	-6.89%	1.19%	-1.22%	0.87%	-5.67%	0.32%
过去一年	22.33%	1.34%	13.58%	0.99%	8.75%	0.35%
过去三年	19.70%	1.62%	12.64%	1.40%	7.06%	0.22%
自基金合同生 效起至今	249.67%	1.60%	109.66%	1.37%	140.01%	0.23%
3.2.2 白基金	合同生效以3	x基金份额累	计净值增长率	变动及其与同	即业绩比较基准收	益率变动的比较



注:按基金合同规定,本基金且基金合同生效起6个月內为建仓期,依据本基金2005年8月31日 关于调 大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》。本基金投资股票比例为基金资产净值的30%—95%,投 债券比例为基金资产净值的0%—65%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 律法规另有规定时从其规定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。 84 管理人报告

法特性规为有规定的从具规定。概主依百口本鉴虑的合则农政性的已处到基金管间中规定的各项化例。 \$4 管理人报告 4.1. 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及基金经时经验 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,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中率信托投资有限公司 2%。)产证涉股份有限公司 2%。)产证涉股份有限公司 2%。)产证涉股份有限公司 2%。)产证涉股份有限公司 2%。)产证涉股份有限公司 2%。)产证涉股份有股公司 2%。)产证涉股份有股公司 2%。)产证涉股份有股公司 2%。)户在证券股份有股公司 2%。)户在证券股份有股公司 2%。)中区市政上设定证成长40ETF联接基金。1月16万至基金。并成是非分级债券型证券投资基金。人民下政人政定证成长40ETF联接基金。1月16万型基金,大成份审查证券投资基金。人成价市场长级工资投资基金。人成财营管理2020年命周期证券投资基金、大成份市场企业券投资基金、人成财商股票型证券投资基金、大成财营管理2020年命周期证券投资基金、大成份市场汇券投资基金、企业的制度还券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新版长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成的新成长股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、人成内需增长股票型证券投资基金、人成内需增长股票型证券投资基金、人成价本是企业企业,在12 基金经理,以是金经理即用简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业年限	说明
XLAD	8/1.23	任职日期	离任日期	MLOPONIE-T-PK	DC9.1
施永辉先生	本基金基金 基金	2006年1月21日	-	14年	理学硕士。 曾德信研究产品 电单位间 网络阿尔克 电电信间 网络阿尔克 电阻射 电阻射 电阻射 电阻射 电阻射 电阻射 电阻

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 征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管作建划字信情况的说明 本报告期内、本基金管理人严格遵守(征券法)、征券投资基金法)、伏成蓝筹稳健证券投资基金基金

在1.1 让职公用,高社日期为本基金管理人性的变化。但泰处以此人员资格管理办法,的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金宣生作题职守信情况的说明
本报告期内、本基金管型儿个格遵守。他旁社为、他季投资基金法为、伏成蓝筹稳健证券投资基金基金合同 列耳使有关法律法规的规定。在基金管理企作中,大成蓝筹稳健证券投资基金的投资范围,投资性例,投资组合。证券交易行为。信息按据等符合专关法律法规,中心监管规则加基金合同等规定。本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金的产进行内幕交易和创作为让及进行自机基金投资人利益的关键交易,然后使作会会人类。从自应用基金的产进行内幕交易和创作为以及进行自机基金投资人利益的关键交易,整体或作合法合规,是由一个发展,是一个发展,更多多的发展,是一个一个发展,是一个一个发展,是一个一个发展,是一个一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个发展,是一个一个发展,是一个发展,是一个一个发展,一个一个一个发展,一个一个发展,一个一个一个一个发展,一个一个发展,一个一个一个一个一个一个一个发展,一个一个一

》重点挖掘投资机会。 4.6 管理人的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

2011年6月30日

2011年 6
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,估值委员会各成员中包括两名投资组合经理。
股票程效常、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整则证券投资组为企业。
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整则证券的证券的重大事件、从而确定估值下需要进行估值测算或者现象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估的运输事理,监察稽核部负责申核估值政策和程序的占值,约其是基金的是非常行为通估值测整事项。监察稽核部负责申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,并负责估值遗够事项的信息按露工作。
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。基金付值成实策的设定和谐较平均还有规度,并与托管设施发明的定转动值的规则或感。问估值委员会提供值多考息。参与估值该对计论对对需采用特别估值程序的证券,基金管理人投资是使许多过度,由估值委员会讨论以定特别估值方案并与托管符的通信基金运营部具体持位有关的设明。
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,截止报告期本基金大的企分配。
4.7 管理人对报告期内基金和润分配情况的说明
本报告期内,由银行股份有限公司(以下称本托管人)产成以界,全部分的社会设备。以下称本基金管理人严格遵守。但券投资应的进行、产品中的实验发表。从其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进期内本基金投资运作进期中信,净值计算,利润分配等情况的说明。
5.2 托管人对提告期内本基金投资运作递期中信,净值计算利润分是专员的的规定。对本基金管理人的投资运作进期内本是金货资的基金,对是金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核、未发现本基金管理人存在预告基金投资的主发,对是资金的特别,对是资金的程度,并由则分者指表中的分析,是他当分表的是实现,是他可以指统,是他国的对方,是可以是是他可以有关。并且不可以有关。并且不可以有关。并且不可以有关。并且不可以有关。并且不可以并充在现的,对关。任何债费,对表的是有,对表的是有关键,对表的并是有可以对表,并是如此是一个,对于是自动的

6.1资产负债表 会计主体:大成蓝筹稳健证券投资基金

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	597,533,976.86	499,801,664.67
结算备付金	6,783,254.78	20,147,650.50
存出保证金	7,347,782.56	2,388,549.12
交易性金融资产	12,922,774,331.95	14,893,278,075.93
其中:股票投资	12,436,514,331.95	14,276,489,339.33
基金投资	_	-
债券投资	486,260,000.00	616,788,736.60
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	2,264,389.26	_
应收利息	6,633,282.67	9,161,056.68
应收股利	4,172,410.40	-
应收申购款	229,954.09	712,622.92
递延所得税资产	_	-
其他资产	_	
资产总计	13,547,739,382.57	15,425,489,619.82
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	37,299.46	178,310,904.44
应付赎回款	3,504,023.20	2,400,215.00
应付管理人报酬	16,055,133.39	19,610,513.99
应付托管费	2,675,855.55	3,268,418.99
应付销售服务费	_	-
应付交易费用	9,509,709.57	27,657,103.17
应交税费	-	7,200.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	_	-
其他负债	2,485,513.21	2,415,699.88
负债合计	34,267,534.38	233,670,055.47
所有者权益:		
实收基金	16,884,723,950.84	17,674,871,946.19
未分配利润	-3,371,252,102.65	-2,483,052,381.84
所有者权益合计	13,513,471,848.19	15,191,819,564.35
负债和所有者权益总计	13,547,739,382.57	15,425,489,619.82

会计主体:大成蓝筹稳健证券投资基金

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	-865,820,898.52	-2,812,335,445.17
1.利息收入	11,675,438.90	10,407,610.73
其中:存款利息收入	2,644,187.92	3,408,752.33
债券利息收入	6,529,789.16	4,955,261.84
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	2,501,461.82	2,043,596.56
其他利息收入	_	-
2.投资收益 假失以""填列)	-26,173,430.19	73,569,454.76
其中:股票投资收益	-111,546,865.19	17,378,151.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,456,935.77	-27,320.00
资产支持证券投资收益	_	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	81,916,499.23	56,218,623.52
3.公允价值变动收益 假失以""号填列)	-851,866,960.01	-2,897,079,876.60
4.汇兑收益 假失以""号填列)	-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)	544,052.78	767,365.94
减:二、费用	150,227,236.21	166,719,324.30
1.管理人报酬	105,856,779.55	104,414,713.11
2.托管费	17,642,796.60	17,402,452.18
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	26,465,301.89	44,225,913.83
5.利息支出	-	418,000.26
其中:卖出回购金融资产支出	-	418,000.26
6.其他费用	262,358.17	258,244.92
三、利润总额 (亏损总额以""号填列)	-1,016,048,134.73	-2,979,054,769.47
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以""号填列)	-1,016,048,134.73	-2,979,054,769.47

本 报告期:2011年1月1日	主 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)	17,674,871,946.19	-2,483,052,381.84	15,191,819,564.35	
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数(本期利润)	-	-1,016,048,134.73	-1,016,048,134.73	
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)	-790, 147, 995.35	127,848,413.92	-662,299,581.43	
其中:1.基金申购款	193,953,925.54	-31,891,095.15	162,062,830.39	
2.基金赎回款	-984, 101, 920.89	159,739,509.07	-824,362,411.82	
四、本期向基金份额持有人 分配利润产生的基金净值变 动 (争值减少以""号填列)	-	-	-	
五、期末所有者权益 基金净 值)	16,884,723,950.84	-3,371,252,102.65	13,513,471,848.19	
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)	19,448,035,820.73	-3,645,984,559.82	15,802,051,260.91	
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数(本期利润)	-	-2,979,054,769.47	-2,979,054,769.47	
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)	-918,331,517.72	216,703,751.38	-701,627,766.34	
其中:1.基金申购款	132,703,210.14	-36,243,012.56	96,460,197.58	
2.基金赎回款	-1,051,034,727.86	252,946,763.94	-798,087,963.92	
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	18,529,704,303.01	-6,408,335,577.91	12,121,368,725.10	

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

6.4 推表附注 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 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 基金托管人、基金代销机构 基金管理人的股东、基金代销机构 国银河投资管理有限公司 基金管理人的股东

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 本报告制发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

2011 半年度 报告摘要

ř					金额单位:人民币:
ŧ		本其		上年度可比	
Į.	关联方名称	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	70077111	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
	光大证券	2,571,226,838.34	15.08%	6,261,868,487.18	21.90%

6.4.3.1.2 应	立支付关联方的佣金		金額	顶单位:人民币元
关联方名称		2011年1月1日	本期 日至2011年6月30日	
	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	2,145,417.24	15.06%	1,894,372.57	19.93%
关联方名称			度可比期间 日至2010年6月30日	
	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	5,322,566.06	22.27%	11,929,037.53	38.99%

注:1.上述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和经手费后的净额列示,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

		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	105,856,779.55	104,414,713.11		
其中:支付销售机构的客户维 护费	20,376,560.97	20,366,276.97		
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。 64322 基全长签费

0.4.3.2.2 基金化官页		单位:人民币:
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	17,642,796.60	17,402,452.18
注:支付基金托管人中国等 衰,按月支付。其计算公式为:		10.25%的年费率计提,逐日累计至每月

日托管费=前一日基金资产净值x0.25%/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

元。 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

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

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

				単位:人氏巾2	
关联方	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		
名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国银行	597,533,976.86	2,514,629.40	818,240,314.98	3,236,271.08	
注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。					

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

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
600011 4	半能国际	2010/12/29	2011/12/ 23	非公开发 行	5.57	5.28	15,000,000	83,550,000.00	79,200,000.00	-

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。 6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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. 期末(而苏止回购交易中性/为抵押的)而苏 行机,银行间市场债券正回购 于本报告期末、本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。 6.4.3.2 交易所市场债券正回购 于本报告期末、本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。 6.4.5 有助于理解和分析交上根表需要说明的其他事项 本基金无需要说明的其他事项。

87 投资组合报告

			金额单位:人民币:
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	12,436,514,331.95	91.80
	其中:股票	12,436,514,331.95	91.80
2	固定收益投资	486,260,000.00	3.59
	其中:债券	486,260,000.00	3.59
	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	604,317,231.64	4.46
6	其他各项资产	20,647,818.98	0.15
7	合计	13,547,739,382.57	100.00

(113)	1.	11年天初	3	COLUI III	口盔並以) 伊国比例 (%)
A	农、林、牧、渔业			49,895,864.48	0.37
В	采掘业			198,097,500.00	1.47
С	制造业			10,918,597,189.42	80.80
C0	食品、饮料			1,345,159,930.08	9.95
C1	纺织、服装、皮料	É		-	0.00
C2	木材、家具			-	0.00
C3	造纸、印刷			-	0.00
C4	石油、化学、塑料	交、塑料		111,606,921.55	0.83
C5	电子			904,573,149.20	6.69
C6	金属、非金属			1,430,134,989.11	10.58
C7	机械、设备、仪制	表		4,707,465,375.10	34.84
C8	医药、生物制品	1		2,395,221,747.70	17.72
C99	其他制造业			24,435,076.68	0.18
D	电力、煤气及水	的生产和供应	lk.	79,200,000.00	0.59
Е	建筑业			-	0.00
F	交通运输、仓储	MV		-	0.00
G	信息技术业			847,403,422.38	6.27
Н	批发和零售贸易	易		11,512,347.00	0.09
I	金融、保险业			235,364,682.42	1.74
J	房地产业			57,096,986.41	0.42
K	社会服务业			12,258,000.00	0.09
L	传播与文化产业	l/		-	0.00
M	综合类			27,088,339.84	0.20
		合计		12,436,514,331.95	92.03
7.3	3 期末按公允位	介值占基金资产	*净值比例大小排序的	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	600519	贵州茅台	5,250,000	1,116,307,500.00	8.26
2	000538	云南白药	15,840,000	904, 147, 200.00	6.69

M	综合类			27,088,339.84	0.20
		合计	12,436,514,331.95		92.03
7.3	期末按公允份	值占基金资产	*净值比例大小排序的	的前十名股票投资明细	金额单位:人民币
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	600519	贵州茅台	5,250,000	1,116,307,500.00	8.26
2	000538	云南白药	15,840,000	904, 147, 200.00	6.69
3	600585	海螺水泥	28,808,186	799,715,243.36	5.92
4	000527	美的电器	42,550,000	782,494,500.00	5.79
5	600031	三一重工	35,110,202	633,388,044.08	4.69
6	000423	东阿阿胶	14,303,996	590, 182, 874.96	4.37
7	000338	潍柴动力	12,275,151	557,660,109.93	4.13
8	600518	康美药业	39,559,073	520,597,400.68	3.85
9	600690	青岛海尔	17,558,173	490,750,935.35	3.63
10	600271	航天信息	17,857,564	461,439,453.76	3.41
			基金投资的所有股票	即细,应阅读登载于	大成基金管理有限公司网:
11 m . 1/2	www.defund.com	, on M7半年度:	脱生 小 マ		

7.4.1	系月大八玉?	<u> </u>	一/ 中国2%以前20石的权示权页明	细 金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 %)
1	600585	海螺水泥	662,120,710.14	4.30
2	600031	三一重工	591,529,073.70	3.89
3	002106	莱宝高科	534,923,210.36	3.53
4	000401	冀东水泥	422,693,730.54	2.73
5	600104	上海汽车	382,985,908.71	2.53
6	600418	江淮汽车	357,228,143.87	2.3
7	002056	横店东磁	339,831,278.66	2.2
8	000400	许继电气	276,555,415.11	1.8
9	000012	南 玻A	254,821,679.50	1.6
10	000528	柳工	251,097,168.89	1.6
11	601989	中国重工	242,220,471.88	1.5
12	000568	泸州老窖	231,645,232.56	1.5
13	000680	山推股份	228,375,884.32	1.5
14	601006	大秦铁路	205,336,552.06	1.3
15	600518	康美药业	180,763,227.26	1.1
16	000157	中联重科	158,904,904.89	1.0
17	000021	长城开发	157,898,425.50	1.0
18	601766	中国南车	151,565,606.59	1.0
19	600166	福田汽车	150,876,136.33	0.9
20	601668	山国建筑	1/4 713 514 48	0.0

601318 695,100,557.66 601166 兴业银行 519,160,475.94 600000 458,005,362.44 600029 南方航空 392,542,884.11 5 600177 雅戈尔 309,012,683.84

000983

600348

西山煤电

300,619,311.24 294,355,170.03

289,898,906.20

289,028,449.67

3.42

2.03

1.91

10	600036	招商银行	275,448,841.63	1.8	
11	600383	金地集团	264,588,929.23	1.7	
12	601111	中国国航	248,460,033.54	1.6	
13	002142	宁波银行	239,575,788.11	1.5	
14	000729	燕京啤酒	232,000,759.93	1.5	
15	000680	山推股份	214,972,138.87	1.4	
16	601006	大秦铁路	212,328,040.54	1.4	
17	000069	华侨城A	208, 187, 196.53	1.3	
18	000829	天音控股	204, 221, 751.16	1.3	
19	002028	思源电气	168,854,521.10	1.1	
20	601169	北京银行	168,102,278.20	1.1	
注:本期累计卖出金额指卖出成交金额 成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。					

743 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本 (成交)总额

5 企业短期融资券 6 中期票据

实出股界	票收入 成交)总额		8,987,475,173.61
	上述金额均指成交金额 成交单期末按债券品种分类的债券投	单价乘以成交数量),不考虑相关交易 资组合	费用。
			金额单位:人民币元
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	国家债券	_	0.00
2	央行票据	486,260,000.00	3.60
3	金融债券	_	0.00
	其中:政策性金融债	_	0.00
	A sy felicide		

金额单位:人民币元 1001072 10央行票据72 2,000,000 195,480,000,00 1101022 11央行票据22 2,000,000 193,100,000.00

| 1001077 | 10大万票程7 | 1,000,000 | 97,680,000,00 | 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细本基金本报告期末末持有资产支持证券。 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。

平金速平成日前水水下行众地。 7.9 投资组合报告附注 7.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年 内受到公开通费,处罚的前形。 7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3	期末其他各项资产构成	
		单位:人民币
序号	名称	金额
1	存出保证金	7,347,782.5
2	应收证券清算款	2,264,389.2
3	应收股利	4,172,410.4
4	应收利息	6,633,282.6
5	应收申购款	229,954.0
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	20,647,818.9
7.0.4	期	

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

由于四舍五人原因,分项之和与合计可能 §8 基金份额持有人信息 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

7.9.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

					1	份额单位:份	
持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构					
		机构投资者			个人投资者		
		持有份额	占总份额 比例		持有份额	占总份额 比例	
883,199	19,117.69	516,271,111.60	3.06%		16,368,452,839.00	96.94%	
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况							
项目		持有份额总数(分)			占基金总份额比例		
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金		3,732.20			0.00002%		

Ť	单位:6
基金合同生效日(2004年6月3日)基金份额总额	2,234,307,480.29
本报告期期初基金份额总额	17,674,871,946.19
本报告期基金总申购份额	193,953,925.54
减:本报告期基金总赎回份额	984,101,920.89
本报告期基金拆分变动份额	_
本报告期期末基金份额总额	16,884,723,950.84

§10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

10.1 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。
10.2 基金管理人基金任管人的专门基金任管部门的重大人事变动
本基金托管人的基金托管的分专门基金任管部门的重大人事变动
本基金托管人的基金托管部门的重大人土变动。
本报告期内、根据正监会、筷子核准中国银行报份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的
批复】李要华先生担任本基金托管人一中国银行托管及投资都服务部总经理。因工作调动,董杰先生不
再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。
10.3 涉及基金管理人,基金射态基金扩管业务的诉讼事项。
10.4 基金投资策略的改变
本基金投资策略的改变
和基金进行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本基金提供审计服务至今。
10.6 管理人,并管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
和尼街,本基金置用工券公司交易单元的有关情况。
10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况。
2.6额管理人员一张受到监管部门稽查或处罚。
10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况。
10.7.1 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

	交易单	股票交	易	应支付该券		
券商名称	元数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
光大证券	2	2,571,226,838.34	15.08%	2,145,417.24	15.06%	-
东方证券	1	2,153,039,608.07	12.63%	1,830,072.30	12.84%	-
长江证券	1	1,673,155,367.01	9.81%	1,422,178.35	9.98%	-
招商证券	2	1,227,895,576.12	7.20%	1,001,507.45	7.03%	-
海通证券	2	1,227,270,512.15	7.20%	1,043,173.96	7.32%	-
齐鲁证券	1	1,020,720,033.65	5.99%	867,613.11	6.09%	-
中信证券	2	1,020,228,650.27	5.98%	867,189.90	6.09%	-
华泰联合	1	1,013,554,964.18	5.94%	823,520.08	5.78%	-
申银万国	1	1,007,408,513.31	5.91%	818,527.36	5.74%	-
江海证券	1	864,705,001.64	5.07%	735,001.86	5.16%	-
中银国际	1	686,643,304.10	4.03%	557,901.41	3.92%	-
广州证券	1	467,821,622.66	2.74%	397,649.49	2.79%	-
安信证券	2	432,779,832.46	2.54%	367,863.17	2.58%	-
国信证券	1	413,972,443.90	2.43%	336,355.77	2.36%	-
国泰君安	1	372,507,699.15	2.18%	302,665.15	2.12%	-
中金公司	2	346,486,362.17	2.03%	281,524.47	1.98%	-
东莞证券	1	314,074,103.26	1.84%	255,187.04	1.79%	-
渤海证券	1	145,119,927.10	0.85%	117,910.83	0.83%	-
银河证券	2	92,909,731.74	0.54%	78,972.89	0.55%	-
中投证券	2	_	0.00%	_	0.00%	-
中航证券	1	_	0.00%	_	0.00%	-
中邮证券	1	_	0.00%	_	0.00%	-
财富证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	_	0.00%	_	0.00%	-
华宝证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	2	_	0.00%	_	0.00%	-
湘财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

一 研究实力较强。能提供包括研究报告、路海服务、协助进行上市公司调件等研究服务;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

但 具备各投资组合运作所需的局效、安主的週间原行,用生罗坦又必可用开始之为完全自己。 券交易需要; 伍 施提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务; 长 州关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。 租用证券公司交易单元的程序;首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成 劵商服务评价表》, 然后根据评分高低进行选择基金交易单元。 2、本报告期内本基金退租的交易单元;国元证券、北京高华、长江证券、齐鲁证券、国信证券、中金公司、 新增交易单元;长江证券、中信证券、安信证券、东方证券、中金公司、中投证券、湘财证券、海通证券、银河证

10.7.2 其全租田证券公司亦易单元进行其他证券投资的情况

						金额单位:人民币
券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	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
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.009
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.009
长江证券	29,355,172.40	42.92%	-	0.00%	-	0.009
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.009
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.009
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.009
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
联合证券	858,075.00	1.25%	-	0.00%	-	0.00
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
广州证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
安信证券	38,175,092.70	55.82%	-	0.00%	1	0.00
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
国泰君安	_	0.00%	-	0.00%	-	0.00
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
东莞证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
银河证券	_	0.00%	-	0.00%	-	0.00
中投证券	_	0.00%	-	0.00%	1	0.00
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
中邮证券	_	0.00%	-	0.00%	-	0.00
财富证券	_	0.00%	-	0.00%	-	0.00
国都证券	_	0.00%	-	0.00%	1	0.00
华宝证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
湘财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00
合计	68,388,340,10	100.00%	_	0.00%	_	0.00

大成基金管理有限公司