

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

81 重要提示及目录

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月24日出具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,应阅读半年度报告全文。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

92 基金简介

基金基本情况	大成优选封闭
基金代码	150002
基金交易代码	150002
基金运作方式	契约型封闭式,基金合同生效满12个月后,若基金份额净值连续50个交易日超过20%,则基金管理人将在30个工作日内召开基金份额持有人大会,审议有关基金转换运作方式为上市开放式基金(LOF)的事项。
基金合同生效日	2007年8月1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
报告期末基金份额总额	4,674,305,067.90份
基金合同存续期	5年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年9月7日

2.1 基金基本情况	大成优选封闭
基金代码	150002
基金交易代码	150002
基金运作方式	契约型封闭式,基金合同生效满12个月后,若基金份额净值连续50个交易日超过20%,则基金管理人将在30个工作日内召开基金份额持有人大会,审议有关基金转换运作方式为上市开放式基金(LOF)的事项。
基金合同生效日	2007年8月1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
报告期末基金份额总额	4,674,305,067.90份
基金合同存续期	5年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年9月7日

2.2 基金产品说明	追求基金资产长期增值
投资目标	本基金将在全球视野下,基于宏观经济研究,确定大类资产配置比例;通过上市公司基本面分析,主要采用优选个股的主动投资策略,或取超额收益。优选个股是指数股、深入、全面地了解上市公司基本面,动态评估公司价值,当股价低于合理价值区域时,深入介入持有;在股价回到合理价值的过程中,分享个股带来的超额收益。
业绩比较基准	80%沪深300指数+20%中信标普综合指数
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人及基金托管人	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
信息披露负责人	魏春雷 电话:0755-83183388 传真:0755-83195888
2.4 信息披露方式	基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.dcfund.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标	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	-63,427,612.65
本期利润	-278,870,912.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0597
本期基金份额净值增长率	-5.61%
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	-0.0129
期末基金资产净值	4,716,583,242.90
期末基金份额净值	1.009

注:1.本期已实现收益指本期利息收入、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认购或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。
3.本基金业绩指标

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.51%	2.57%	1.13%	2.11%	0.38%	0.46%
过去三个月	-7.00%	2.67%	-4.32%	1.99%	-2.68%	0.68%
过去六个月	-5.61%	2.54%	-1.76%	1.82%	-3.85%	0.72%
过去一年	22.42%	2.58%	15.28%	2.24%	7.14%	0.34%
过去三年	55.81%	3.24%	12.16%	3.42%	43.65%	-0.18%
自基金合同生效起至今	6.25%	3.88%	-21.54%	3.70%	27.79%	0.18%

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	
图例	大成优选股票型证券投资基金
图例	业绩比较基准

注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内使基金的资产配置比例符合基金合同的约定,截至报告日本基金的资产配置比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 基金投资组合报告	金额单位:人民币元	
3.3.1 期末基金资产组合情况		
资产类别	金额	占基金总资产比例(%)
权益投资	4,365,180,881.49	92.33
固定收益投资	278,870,912.51	5.91
金融资产投资	4,644,051,794.00	99.24
其他资产	72,531,448.90	1.54

3.3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	金额单位:人民币元	
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	28,288,956.00	0.60
B 采矿业	1,972,875.00	0.04
C 制造业	2,588,430,223.68	54.88
CO 食品饮料	472,730,385.17	10.02
C1 纺织、服装、皮毛	61,249,612.85	1.30
C2 木材、家具	-	0.00
C3 造纸印刷	-	0.00
C4 石油、化学、塑胶、塑料	341,515,259.10	7.24
C5 电子、电器、通讯	1,240,077,618.63	26.29
C6 金属、非金属	-	0.00
C7 机械、设备、仪表	1,591,827,116.03	33.75
C8 医药、生物制品	182,357,463.38	3.87
C9 其他制造业	-	0.00
D 电力、煤气、水及热力生产和供应业	52,800,000.00	1.12
E 建筑业	-	0.00
F 交通运输、仓储业	-	0.00
G 信息技术业	-	0.00
H 批发和零售贸易	364,416,804.78	7.73
I 房地产业	-	0.00
J 社会服务业	-	0.00
L 传播与文化业	91,167,278.40	1.93
M 综合类	-	0.00
合计	4,365,180,881.49	92.55

3.3.3 报告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	600600	青岛海尔	16,701,841	466,816,455.95	9.90
2	000651	格力电器	19,752,875	464,192,562.50	9.84
3	600036	招商银行	32,543,796	423,720,232.92	8.98
4	600132	重庆啤酒	7,340,382	421,337,926.80	8.93
5	000527	美的电器	20,466,336	379,687,224.44	8.05
6	002024	苏宁电器	28,447,028	364,416,804.78	7.73
7	601318	中国平安	47,013,029	338,518,909.83	7.18
8	600703	三安光电	16,186,594	256,770,141.60	5.44
9	002142	宁波银行	21,404,271	232,878,468.48	4.94
10	000566	海南医药	7,550,989	167,858,485.47	3.56

3.3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
6	060014	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
7	060015	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
8	060016	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
9	060017	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
10	060018	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	金额单位:人民币元				
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110013	11国债(3)	1,000,000	1,000,000.00	2.12
2	110014	11国债(4)	1,000,000	1,000,000.00	2.12
3	110015	11国债(5)	1,000,000	1,000,000.00	2.12
4	110016	11国债(6)	1,000,000	1,000,000.00	2.12
5	110017	11国债(7)	1,000,000	1,000,000.00	2.12

3.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细	金额单位:人民币元			
序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	招商银行2010年第一期资产支持证券	1,000,000	1,000,000.00	2.12
2	招商银行2010年第二期资产支持证券	1,000,000	1,000,000.00	2.12
3	招商银行2010年第三期资产支持证券	1,000,000	1,000,000.00	2.12
4	招商银行2010年第四期资产支持证券	1,000,000	1,000,000.00	2.12
5	招商银行2010年第五期资产支持证券	1,000,000	1,000,000.00	2.12

3.3.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	金额单位:人民币元			
序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,000,000	1,000,000.00	2.12
2	白银	1,000,000	1,000,000.00	2.12
3	铂金	1,000,000	1,000,000.00	2.12
4	钯金	1,000,000	1,000,000.00	2.12
5	铑金	1,000,000	1,000,000.00	2.12

3.3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细	金额单位:人民币元			
序号	合约名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	IF1109	1,000,000	1,000,000.00	2.12
2	IF1110	1,000,000	1,000,000.00	2.12
3	IF1111	1,000,000	1,000,000.00	2.12
4	IF1112	1,000,000	1,000,000.00	2.12
5	IF1113	1,000,000	1,000,000.00	2.12

3.3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细	金额单位:人民币元			
序号	合约名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TF1109	1,000,000	1,000,000.00	2.12
2	TF1110	1,000,000	1,000,000.00	2.12
3	TF1111	1,000,000	1,000,000.00	2.12
4	TF1112	1,000,000	1,000,000.00	2.12
5	TF1113	1,000,000	1,000,000.00	2.12

3.3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00

3.3.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	金额单位:人民币元				
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	060009	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
2	060010	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
3	060011	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
4	060012	普华永定	1,000,000	100.00	0.00
5	060013	普华永定	1,000,000	100.00	0.00