（上接D81版）

合并现金流量表
2011年1—6月

单位：千元 币种：人民币

项目	附注	本期金额	上期金额
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金		2,827,507	2,941,158
发放贷款及垫款的净减少额		53,941	
客户存款和同业存放款项净增加额			
向中央银行借款净增加额			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收到原保险合同保费取得的现金			
收到再保险业务现金净额			
保户储金及投资款净增加额			
处置交易性金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金			
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额			
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		139,478	207,367
经营活动现金流入小计		3,020,926	3,148,525
购买商品、接受劳务支付的现金		1,163,508	1,209,241
????客户存款和同业存放款项净减少额		180,408	
客户贷款及垫款净增加额			
存放中央银行和同业款项净增加额		442,607	
支付原保险合同赔付款项的现金			
支付利息、手续费及佣金的现金			
支付保单红利的现金			
支付给职工以及为职工支付的现金		464,302	403,128
支付的各项税费		537,967	445,585
支付其他与经营活动有关的现金		108,119	82,639
经营活动现金流出小计		2,896,911	2,140,593
经营活动产生的现金流量净额		124,015.00	1,007,932.00
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		103,133	253,140
取得投资收益收到的现金		155,368	258,467
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		547,171	346,916
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金		1,007,214	15,000
投资活动现金流入小计		1,812,886	873,523
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		846,048	1,362,989
投资支付的现金		711,846	1,325,941
质押贷款净增加额			
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金		582	14,500
投资活动现金流出小计		1,558,476	2,703,430
投资活动产生的现金流量净额		254,410	-1,829,907
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		35,000	15,000
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		35,000	15,000
取得借款收到的现金		171,477	5,129,438
发行债券收到的现金			1,500,000
收到其他与筹资活动有关的现金		151,562	72,455
筹资活动现金流入小计		358,039	6,716,893
偿还债务支付的现金		1,676,972	3,414,081
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		196,897	1,797,024
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		20,433	12,020
支付其他与筹资活动有关的现金		12,056	1,403,125
筹资活动现金流出小计		1,885,925	6,614,230
筹资活动产生的现金流量净额		-1,527,886	102,663
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-2,026	-208
五、现金及现金等价物净增加额		-1,151,487	-719,520
加：期初现金及现金等价物余额		6,646,591	2,345,725
六、期末现金及现金等价物余额		5,495,104	1,626,205

法定代表人：李令红　　主管会计工作负责人：戴敏伟　　会计机构负责人：金国平

母公司现金流量表
2011年1—6月

单位：千元 币种：人民币

项目	附注	本期金额	上期金额
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金		1,528,641	1,644,927
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		43,253	272,421
经营活动现金流入小计		1,571,894	1,917,348
购买商品、接受劳务支付的现金		290,909	268,623
支付给职工以及为职工支付的现金		340,260	323,017
支付的各项税费		277,815	246,168
支付其他与经营活动有关的现金		174,461	256,585
经营活动现金流出小计		1,083,445	1,094,393
经营活动产生的现金流量净额		488,449	822,955
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		109,151	267,439
取得投资收益收到的现金		639,592	417,932
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		215,794	120,852
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		964,537	806,223
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		421,401	458,107
投资支付的现金		902,308	1,505,941
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金		80,000	
投资活动现金流出小计		1,403,709	1,964,048
投资活动产生的现金流量净额		-439,172	-1,157,825
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			3,350,000
发行债券收到的现金			1,500,000
收到其他与筹资活动有关的现金		73,000	33,941
筹资活动现金流入小计		73,000	4,883,941
偿还债务支付的现金		1,500,000	2,410,400
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		83,618	1,678,513
支付其他与筹资活动有关的现金			1,313,108
筹资活动现金流出小计		1,583,618	5,402,021
筹资活动产生的现金流量净额		-1,510,618	-518,080
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-8	-112
五、现金及现金等价物净增加额		-1,461,349	-853,062
加：期初现金及现金等价物余额		5,045,309	1,505,558
六、期末现金及现金等价物余额		3,583,960	652,496

法定代表人：李令红　　主管会计工作负责人：戴敏伟　　会计机构负责人：金国平

合并所有者权益变动表
2011年1—6月

单位：千元 币种：人民币

项目	本期金额									
	归属于母公司所有者权益								少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本（或股本）	资本公积	减：库存股	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他		
一、上年年末余额	12,800,000	7,594,768			445,802	206	2,007,212		757,022	23,605,010
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年年初余额	12,800,000	7,594,768			445,802	206	2,007,212		757,022	23,605,010
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		10,976					855,537		26,093	892,606
（一）净利润							1,239,537		19,609	1,259,146
（二）其他综合收益		-24,860								-24,860
上述（一）和（二）小计		-24,860					1,239,537		19,609	1,234,286
（三）所有者投入和减少资本		35,836							28,387	64,223
1. 所有者投入资本									35,001	35,001
2. 股份支付计入所有者权益的金额										
3.其他		35,836							-6,614	29,222
（四）利润分配							-384,000		-21,903	-405,903
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备										
3. 对所有者（或股东）的分配							-384,000		-21,903	-405,903
4.其他										
（五）所有者权益内部结转										
1. 资本公积转增资本（或股本）										
2. 盈余公积转增资本（或股本）										
3. 盈余公积弥补亏损										
4.其他										
（六）专项储备										
1. 本期提取										
2. 本期使用										
（七）其他										
四、本期期末余额	12,800,000	7,605,744			445,802	206	2,862,749		783,115	24,497,616

单位：千元 币种：人民币

项目	上年同期金额									
	归属于母公司所有者权益								少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本（或股本）	资本公积	减：库存股	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他		
一、上年年末余额	10,800,000	2,068,707			251,990		1,333,680		272,243	14,726,620
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年年初余额	10,800,000	2,068,707			251,990		1,333,680		272,243	14,726,620
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		16,014					423,809		4,909	444,732
（一）净利润							1,105,387		4,379	1,109,766
（二）其他综合收益		-17,927								-17,927
上述（一）和（二）小计		-17,927					1,105,387		4,379	1,091,839
（三）所有者投入和减少资本		33,941							15,000	48,941
1. 所有者投入资本									15,000	15,000
2. 股份支付计入所有者权益的金额										
3.其他		33,941								33,941
（四）利润分配							-681,578		-14,470	-696,048
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备										
3. 对所有者（或股东）的分配							-681,578		-14,470	-696,048
4.其他										
（五）所有者权益内部结转										
1. 资本公积转增资本（或股本）										
2. 盈余公积转增资本（或股本）										
3. 盈余公积弥补亏损										
4.其他										
（六）专项储备										
1.本期提取										
2.本期使用										
（七）其他										
四、本期期末余额	10,800,000	2,084,721			251,990		1,757,489		277,152	15,171,352

法定代表人：李令红　　主管会计工作负责人：戴敏伟　　会计机构负责人：金国平

母公司所有者权益变动表
2011年1—6月

单位：千元 币种：人民币

项目	本期金额							
	实收资本（或股本）	资本公积	减：库存股	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年年末余额	12,800,000	10,852,171			445,802		1,094,302	25,192,275
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	12,800,000	10,852,171			445,802		1,094,302	25,192,275
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		52,806					611,312	664,118
（一）净利润							995,312	995,312
（二）其他综合收益		-20,194						-20,194
上述（一）和（二）小计		-20,194					995,312	975,118
（三）所有者投入和减少资本		73,000						73,000
1.所有者投入资本								
2.股份支付计入所有者权益的金额								
3.其他		73,000						73,000
（四）利润分配							-384,000	-384,000
1.提取盈余公积								
2.提取一般风险准备								
3. 对所有者（或股东）的分配							-384,000	-384,000
4.其他								
（五）所有者权益内部结转								
1.资本公积转增资本（或股本）								
2.盈余公积转增资本（或股本）								
3.盈余公积弥补亏损								
4.其他								
（六）专项储备								
1.本期提取								
2.本期使用								
（七）其他								
四、本期期末余额	12,800,000	10,904,977			445,802		1,705,614	25,856,393

单位：千元 币种：人民币

项目	上年同期金额							
	实收资本（或股本）	资本公积	减：库存股	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年年末余额	10,800,000	5,352,477			251,990		681,578	17,086,045
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	10,800,000	5,352,477			251,990		681,578	17,086,045
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		22,442					170,982	193,424
（一）净利润							852,560	852,560
（二）其他综合收益		-11,499						-11,499
上述（一）和（二）小计		-11,499					852,560	841,061
（三）所有者投入和减少资本		33,941						33,941
1.所有者投入资本								
2.股份支付计入所有者权益的金额								
3.其他		33,941						33,941
（四）利润分配							-681,578	-681,578
1.提取盈余公积								
2.提取一般风险准备								
3. 对所有者（或股东）的分配							-681,578	-681,578
4.其他								
（五）所有者权益内部结转								
1.资本公积转增资本（或股本）								
2.盈余公积转增资本（或股本）								
3.盈余公积弥补亏损								
4.其他								
（六）专项储备								
1.本期提取								
2.本期使用								
（七）其他								
四、本期期末余额	10,800,000	5,374,919			251,990		852,560	17,279,469

法定代表人：李令红　　主管会计工作负责人：戴敏伟　　会计机构负责人：金国平

7.3 本报告期无会计政策、会计估计的变更。

7.4 本报告期无前期会计差错更正。

董事长：李令红
宁波港股份有限公司
2011年8月28日

（上接D83版）

网址：www.ciccs.com.cn

（74）齐鲁证券有限公司
办公地址：山东省济南市经十路20518号
法定代表人：李玮
客户服务电话：95538
联系人：吴阳
电话：0531-81283938
传真：0531-81283900
网址：www.qlzq.com.cn

（75）日信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔伯杰
联系电话：010-88086830
联系人：陈韦杉
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn

（76）光龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
联系电话：0931-8490208
甘肃省客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com

（77）财富证券有限责任公司
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表：周晖
客户服务热线：0731-84403319
联系人：胡智
电话：0731-84779521
传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com

（78）广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客服电话：0591-96326
联系人：张鹏
电话：0591-87278701/
传真：0591-87841150
网址：www.gfhfzq.com.cn

（79）大通证券股份有限公司
客服电话：4008-169-169
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
网址：www.daton.com.cn

（80）中原证券股份有限公司
地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人：石保上
客服电话：0371-967218、4008139666
联系人：程月艳、耿铭
联系电话：0371-65585670
联系传真：0371-65585665
网址：www.ccnew.com

（81）西南证券股份有限公司
地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：王珠林
客服电话：4008096096
联系人：徐推筠、杨再巧
网址：www.swsc.com.cn

（82）山西证券股份有限公司
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：侯巍
客服电话：0351-8686868
联系人：张治国
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn

（83）天源证券经济有限公司
注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人：林小明
电话：0755-33331188
传真：0755-33329815
统一客服电话：4006543218
公司网站地址：www.tyzxj.com.cn

（84）天风证券有限责任公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
联系人：翟璟
联系电话：（027）87618882/（028）86711410
传真：（027）87618863
公司网站：www.tfzq.com

（85）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人：曾小普
联系人：徐美云
电话：0791-6285337
传真：0791-6282293
网址：www.gsstock.com

3.场内代销机构

场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员。名单详见上海证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：陈耀先
电话：010-58598839
传真：010-58598907
联系人：朱立元

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人：王玲
电话：0755-22163333
传真：0755-22163390
联系人：宋萍萍
经办律师：靳庆军、宋萍萍

（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1318号星展银行大厦6楼
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：汪棣、金毅
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：金毅

四、基金的名称

本基金名称：大成积极成长股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：股票型基金

六、基金的运作方式

本基金运作方式：契约型开放式

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围限于国内依法发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，主要投资对象为深、沪两市上市A股中成长性好、发展前景广阔的上市公司。

股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，其中，权证投资比例范围为0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为5%-40%，其中，资产支持证券投资比例范围为0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例不低于基金资产净值的5%。

此外，如法律法规或中国证监会修改对基金投资品种的规定，基金管理人在履行适当程序后，可以依据新的规定修订本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

九、基金的投资策略

本基金管理人在构建投资组合的过程中，遵循以下投资策略：

1.资产配置策略

本基金主要根据GDP增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数CPI增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标的变化，对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量分析，作出资产配置决策。本基金还将关注国家财政政策、货币政策、产业政策及汇率政策等，进行定性分析，作为定量分析的支持和补充。

2.股票投资策略

本基金力争通过深入、科学的基本面分析，挖掘具有良好成长性的上市公司。

（1）财务指标分析

企业的历史财务表现不但能刻画企业的经营情况、财务健康程度，还可以较大程度上反映其未来成长性。本基金将通过对上市公司过去3年主营业务收入增长率、主营业务利润率、净资产收益率和净利润增长率等财务指标的分析，选择上述财务指标优于行业平均水平的上市公司，建立基金初选股票池。

（2）成长性筛选

具有以下一项或多项特征的上市公司，将进入本基金备选股票池。

1）具有较高创新能力和投资效率的上市公司。创新能力主要通过上市公司研究费用支出、研究成果转化为企业盈利的效果等因素衡量；投资效率主要体现为历年增量投资实现的盈利增长。

2）能够充分从消费升级、产业调整、汇率变革等中国经济结构性变迁中获取收益，促进公司发展的行业龙头上市公司。

3）在行业内具有领先的技术水平或经营模式、创新产品、良好的销售网络、市场品牌或资源垄断等竞争优势，且保持长期发展优势的上市公司。

4）通过整合内部资源、加强企业经营管理等措施，企业盈利能力将会在未来1年内有明显提高的上市公司。

5）具有较强外延扩张能力的上市公司。特别是，有明确重组、购并计划或潜在机会，且重组、购并将显著提升上市公司盈利能力、市场占有率或产能水平，并将在未来1-2年内实施或实现的上市公司。

6）国家政策调整、国际经济形势变化等因素将会对企业盈利水平产生重大积极影响的上市公司。

（3）估值比较

本基金将根据上市公司所处行业、业务模式等特征，综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法，进行估值比较。估值比较将从两方面对投资价值进行分析：一是上市公司在其所处行业内部的相对估值水平；二是与境外类似上市公司的估值水平差异，特别是与香港市场上市公司的差异。本基金将优选估值水平合理的上市公司，作为重点投资对象。

在选择重点投资对象时，对于信息技术、网络媒体、生物制药、环境保护、新材料等新兴产业中成长性好，具有较高技术含量的企业，以及传统产业中成长性突出或正在向新兴产业转型的企业，可以适当放宽估值水平要求。

（4）实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴，以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。

（5）建立投资组合

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立买入和卖出股票名单，并选择合理时机，稳步建立投资组合。在建立投资组合过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

对于少数成长性突出、基本面较好的上市公司，本基金将在保证组合安全性和流动性的前提下，进行适当集中投资并中长线持有；同时，本基金还将通过对具有较好流动性和短期投资机会的品种的短线操作，提高组合收益。

3.固定收益品种投资策略

本基金对固定收益品种的投资主要是为了保持投资组合具有良好流动性，以应对赎回申请。基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和资产支持证券等固定收益品种。基金将根据对利率走势的判断、债券期限结构、信用等级及流动性等因素构建投资组合。

在组合构建与调整过程中，本基金将采用凸度策略、收益率利差策略和回购套利等多种交易方式，提高组合整体收益水平，并控制组合的投资风险。

4.其他投资策略

本基金还可按照有关法律法规和中国证监会的规定，投资于权证、资产支持证券等品种，用于分散组合投资风险，获取稳定收益。

十、基金的业绩比较基准

沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%

注：自2009年2月2日起，本基金的业绩比较基准由原“新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%”，变更为“沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%”，该变更事项已于2009年1月23日公开披露。

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金投资组合报告

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责任。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，于2011年8月2日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取自大成积极成长股票型证券投资基金2011年第2季度报告，截止2011年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	525,840,877.65	16.93
6	其他资产	6,980,288.39	0.22
7	合计	3,105,809,757.21	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,140,000.00	0.23
B	采掘业	338,076,792.11	11.09
C	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	1.37
C6	金属、非金属	226,876,245.65	7.45
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
E	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	4.81
H	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

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明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	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

4. 报告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。

5. 报告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持有债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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.报告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。

8.投资组合报告附注

（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、处罚的情形。

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。本基金认为，该处罚不会对五粮液投资价值构成实质性负面影响。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,560,848.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,176,000.00
4	应收利息	79,054.68
5	应收申购款	279,872.82
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,980,288.39

（4）报告期末基金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债券。

（5）报告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的情况。

（6）由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金的业绩

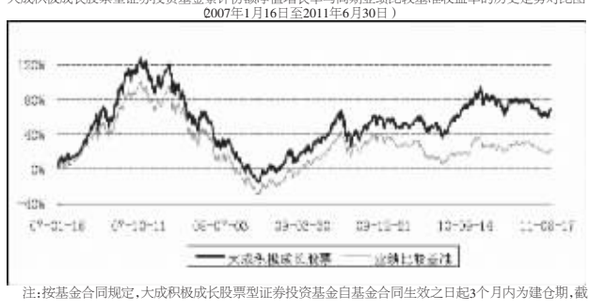
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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。

（一）本报告期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	净值增长率①	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
2007.1.16-2007.12.31	111.49%	1.98%	85.70%	1.75%	25.79%	0.23%
2008.1.1-2008.12.31	-54.32%	2.13%	-57.02%	2.44%	2.70%	-0.31%
2009.1.1-2009.12.31	64.30%	1.89%	72.86%	1.65%	-8.56%	0.24%
2010.1.1-2010.12.31	12.85%	1.34%	-9.26%	1.27%	22.11%	0.07%
2011.1.1-2011.6.30	-5.49%	1.19%	-1.74%	0.99%	-3.75%	0.20%
2007.1.16-2011.6.30	69.30%	1.81%	22.99%	1.77%	46.31%	0.04%

（二）自基金合同生效以来基金累计份额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：大成积极成长股票型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2007年1月16日至2011年6月30日）



注：按基金合同规定，大成积极成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条投资组合中规定的各项比例。

自2009年2月2日起，本基金的业绩比较基准由原“新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%”，变更为“沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%”。

十四、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）证券交易费用；

（4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的资金汇划费用；

（7）按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以从基金资产中列支的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起5个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支取。

（3）上述1基金费用第3-7项费用由基金托管人根据