

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2012年3月28日

大成核心双动力股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

仍在延续,房屋新开工明显放缓,保障房建设进展亦低于预期。海外经济复苏一波三折,欧债危机愈演愈烈,我国出口增速逐渐回落。全年来看,国家控制通胀的政策已初见成效,CPI由年中最高的6.5%下降到12月的4.1%。但通胀经济增长也受到一定抑制,全年GDP增长虽然仍然高达8.9%,但增速逐季显著回落。

对二级市场投资者来说,2011年是异常艰难的一年。除了经济的减速外,资金的异常紧张、市场的急速扩容以及大小非减持,致使市场的估值重心不断下移,而且下移幅度一次次突破投资者的心理底线。虽然一季度下游企业乐观的备货需求导致以水泥、工程机械为代表的周期股大幅上涨,给投资者带来一些期待。但二季度以后,受高铁事件等系列事件影响,基建投资低于预期,投资者对后续增长的担忧加剧,整个市场陷入困境。全年沪深300指数跌幅高达25%,即使表现最好的食品饮料板块跌幅仍超过10%,而电子元器件、有色金属因为估值与盈利预期的双重下调,板块下跌超过340%,跌幅几乎赶上去年金融危机期间水平。

出于对今年经济相对中性的看法,2011年我们调整降低了仓位,增持了金融等绝对估值较低的板块,减持了部分估值偏高的中小个股。同时我们还择机在煤炭、水电等周期性板块进行了一些操作,并获得了一定的收益。但由于对整体市场估值中枢下移的幅度估计有所不足,全年基金净值有所下跌,未能跑赢本基金业绩比较基准。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金份额净值为0.753元,本报告期份额净值增长率为-31.55%,同期业绩比较基准增长率为-18.00%,低于同期业绩比较基准的表现。

4.3 管理人宏观环境、证券市场及行业走势的观点展望
展望2012年,我们判断,随着通胀的回落,国内政策会有更大的操作空间。近期出台的众多扶持中小企业的政策对经济的稳定增长产生积极的作用。资金的边际改善有助于企业缓解经营压力。政府巨大的财政支出也可以对经济的增长和结构调整提供积极的支持。但我们认为货币政策在适度宽松的可能性不大。此外,我们对经济长期增长在增速也相对谨慎。

对资本市场而言,我们认为除了经济基本面以外,市场本身的变化也值得关注。新股发行制度改革,加大对内幕交易的市场,引导长线资金入市等资本市场制度建设将对市场的投资行为产生深远的影响。未来主题投资、题材炒作能获得的收益将大大降低,而个股的内在投资价值将变得异常重要。未来我们将更加注重个股的研究,重点关注上市公司的行业空间、竞争态势、治理结构等长期成长因素。本年度组合内持有的重庆啤酒的下跌对基金净值带来较大影响,对此,本基金将在今后的投资管理中适度降低个股的投资集中度,加强组合风险管理,进一步优化投资组合,以期以我们不懈的努力为持有人创造持续的投资回报。

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、修订及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、运营管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部等部门人员组成。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,估值委员会成员中包括两名投资经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理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采用估值调整或者调整的投资品种;提出合理的数量化分析模型对需要进行估值调整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,执行基金估值政策和程序,并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担任估值小组的成员,参与估值定价的证券的交易情况,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,参与估值定价讨论。对需采用特殊估值程序的证券,基金管理人及时启动特殊估值程序,由估值委员会讨论决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。

本基金经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
本报告期内本基金基金合同的约定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

5.1 报告期内本基金管理人遵规守信情况的说明
2011年,本基金管理人在对大成核心双动力股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,大成核心双动力股票型证券投资基金的托管人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项重要运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对大成基金管理有限公司编制的披露的大成核心双动力股票型证券投资基金2011年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.6 审计报告
本基金会2011年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者想了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

5.7 年度财务报表
资产: 2011年12月31日 2010年12月31日
银行存款 30,384,304.23 102,443,129.64
结算备付金 1,068,395.36 6,617,806.43
存出保证金 582,884.03 909,722.54
交易性金融资产 144,343,990.89 1,024,406,742.20
其中:股票投资 144,343,990.89 1,024,406,742.20
基金投资 -
债券投资 -
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 125,620.01 8,626,286.34
应收利息 7,302.22 25,117.44
应收股利 -
应收申购款 4,553.67 1,179,245.24
递延所得税资产 -
其他资产 -
资产总计 176,517,056.41 1,144,208,049.83
负债和所有者权益: 2011年12月31日 2010年12月31日
短期借款 -
交易性金融负债 -
衍生金融负债 -
买入返售金融负债 -
卖出回购金融资产款 -
应付证券清算款 4,270,053.85 13,199,041.85
应付利息 317,292.88 153,303.65
应付管理人报酬 329,939.22 1,487,976.26
应付托管费 54,994.86 247,996.04
应付销售服务费 -
应付交易费用 712,676.00 1,948,218.84
应交税费 -
应付利息 -
应付股利 -
递延所得税负债 -
其他负债 631,169.18 310,434.84
负债合计 6,316,085.99 17,368,970.18
所有者权益: 2011年12月31日 2010年12月31日
实收基金 226,049,985.85 1,024,888,900.33
未分配利润 -55,849,015.43 102,010,179.32
所有者权益合计 170,200,970.42 1,126,899,079.65
负债和所有者权益总计 176,517,056.41 1,144,208,049.83

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.753元,基金份额总额226,049,985.85份

7.2 利润分配
会计主体:大成核心双动力股票型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

项目 2011年1月1日至2011年12月31日 2010年6月22日至2010年12月31日
一、收入 -173,804,707.45 64,922,550.65
1.利息收入 1,085,699.16 2,142,374.14
其中:存款利息收入 1,085,699.16 1,398,972.98
债券利息收入 -
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“-”号填列) -143,921,177.40 44,492,627.33
其中:股票投资收益 -149,908,242.81 43,916,177.33
基金投资收益 -
债券投资收益 -
资产支持证券投资收益 -
衍生工具收益 -
股利收益 5,987,065.41 576,450.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -32,472,090.37 17,000,146.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列) -
5.其他收入(损失以“-”号填列) 1,502,461.16 1,287,403.82
减:二、费用 22,444,382.12 14,008,724.23
1.管理人报酬 12,529,554.82 7,467,741.71
2.托管费 2,088,259.18 1,244,623.62
3.销售服务费 -
4.交易费用 7,420,185.84 5,182,923.25
5.利息支出 -
6.其他费用 406,382.28 113,435.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -196,249,089.57 50,913,826.42
所得税费用(亏损以“-”号填列) -
四、净利润(净收益以“-”号填列) -196,249,089.57 50,913,826.42

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:大成核心双动力股票型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

项目 2011年1月1日 2011年12月31日 2010年6月22日 2010年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值) 1,024,888,900.33 102,010,179.32 1,126,899,079.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -196,249,089.57 -196,249,089.57
三、本期基金份额交易产生的变动数(本期申购减少以“-”号填列) -148,373,554.36 51,096,352.90 -97,277,201.46
其中:基金申购款 831,214,401.72 101,420,863.44 932,635,205.16
基金赎回款(净赎回减少以“-”号填列) -979,587,956.08 -50,324,510.54 -1,029,912,466.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净派发给以“-”号填列) -979,587,956.08 -50,324,510.54 -1,029,912,466.62
五、期末所有者权益(基金净值) 1,024,888,900.33 102,010,179.32 1,126,899,079.65

7.4 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.5 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.6 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.7 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.8 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.9 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.10 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.11 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.12 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.13 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.14 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.15 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.16 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.17 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.18 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.19 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.20 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.21 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.22 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.23 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.24 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.25 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.26 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.27 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.28 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.29 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.30 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.31 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.32 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.33 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.34 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.35 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.36 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.37 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.38 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.39 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.40 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.41 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.42 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.43 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.44 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.45 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.46 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.47 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.48 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.49 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.50 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.51 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.52 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.53 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.54 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.55 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.56 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.57 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.58 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.59 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.60 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.61 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.62 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.63 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.64 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.65 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.66 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.67 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.68 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.69 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.70 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.71 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.72 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.73 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.74 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.75 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.76 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.77 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.78 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.79 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.80 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.81 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.82 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.83 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.84 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.85 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.86 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.87 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.88 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.89 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.90 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.91 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.92 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.93 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.94 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.95 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.96 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.97 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.98 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.99 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.100 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.101 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.102 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.103 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.104 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎明 范瑾
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.105 本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告附注、财务报表由下列负责人签署:
王鹏 刘莎