大成积极成长股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
送出日期:2013年3月26日

§1 重要提示

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责任。本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012年01月01日起至12月31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
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	2,194,468,343.74份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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以及国家政策的变化,对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析,作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、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。
业绩比较基准	沪深300 指数×80%+中证综合债券指数×20%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	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
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-374,688,760.67	-253,875,531.11	299,514,484.14
本期利润	-62,039,055.45	-831,605,147.15	362,682,880.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0269	-0.2860	0.1274
本期基金份额净值增长率	-3.22%	-26.71%	12.85%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2180	-0.1917	0.1676
期末基金资产净值	1,716,140,150.06	1,946,879,909.82	3,450,474,375.42
期末基金份额净值	0.782	0.808	1.168

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。

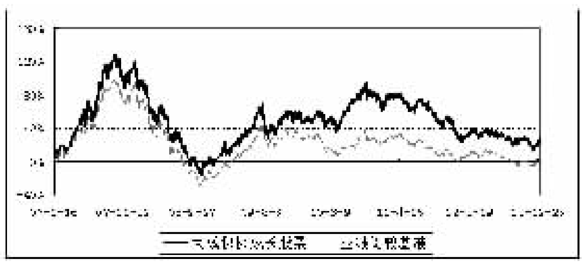
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	0.64%	1.05%	8.16%	1.02%	-7.52%	0.03%
过去六个月	-3.10%	1.05%	2.27%	0.99%	-5.37%	0.06%
过去一年	-3.22%	1.16%	7.09%	1.02%	-10.31%	0.14%
过去三年	-19.96%	1.24%	-21.71%	1.11%	1.75%	0.13%
过去五年	-39.92%	1.60%	-41.83%	1.58%	1.91%	0.02%
自基金转型以来至今	27.06%	1.67%	8.00%	1.62%	19.06%	0.05%

3.2.2 自基金转型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

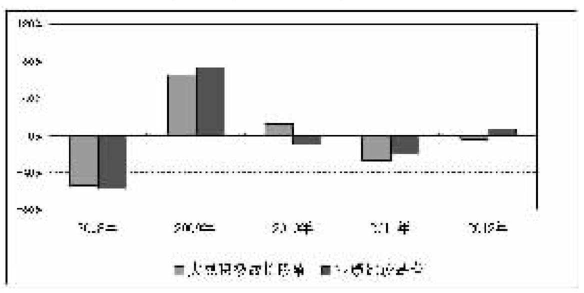


注:1、按基金合同规定,大成积极成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至本报告期本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

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%,

本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2007年1月15日(基金合同生效暨基金转型日)至2009年2月1日为原业绩比较基准(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%)的走势图,2009年2月2日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.6100	112,262,155.64	67,541,031.56	179,803,187.20	2010年度收益分配
2010	0.0500	8,454,742.70	6,623,557.18	15,078,299.88	2009年度收益分配
合计	0.6600	120,716,898.34	74,164,588.74	194,881,487.08	

§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[1999]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,分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2012年12月31日,本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金及景福证券投资基金,2只ETF及2只ETF联接基金:深证成长40ETF、大成深证成长40ETF联接基金、中证500沪市ETF及大成中证500沪市ETF联接基金,1只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数基金及25只开放式证券投资基金:大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成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、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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
		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	2012年12月17日	15年	管理工程硕士。1998年1月—1999年9月,任职于湖南省国际信托投资公司基金管理部、证券管理总部,从事投资和研究工作;1999年10月加入大成基金管理有限公司,历任高级研究员、景博证券投资基金经理助理、景博证券投资基金基金经理(2002年1月11日—2004年3月31日)、景福证券投资基金经理助理。2009年9月24日至2012年12月17日任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。2008年11月26日至2012年12月31日任大成策略回报股票型基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
孙蓓琳女士	本基金基金经理、研究部副总监	2012年12月18日	-	8年	经济学硕士。2004年7月至2007年7月就职于银华基金管理有限公司,历任宏观研究员、行业研究员。2007年7月加入大成基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、研究部总监助理。2011年9月至今担任研究部副总监。2012年7月28日起任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年12月18日起任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
刘洋女士	本基金基金经理助理	2009年10月12日	-	5年	工商管理硕士,2007年7月加入大成基金管理有限公司从事研究工作,现任研究部行业研究员。2009年10月起担任大成策略回报股票型证券投资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《证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运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成积极成长股票型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、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,没有运用基金财产进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市场、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,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,资产管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。资产管理人旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明:债券交易同向交易频率较低;股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素(如个股当日价格振幅较高)及组合经理交易时机选择,即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大,但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量10%。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2012年基金管理人旗下主动投资组合间股票交易存在6笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的情况有9次,原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要,且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年上半年A股市场在国内流动性放松、政策预期向好及海外欧债危机阴影下走出M型走势,下半年市场屡屡期盼的经济企稳反弹迟迟未能出现,相反经济进一步回落,上市公司业绩快速恶化,市场对盈利的一致预期不断下调。尽管3季度末开始经济出现企稳反弹的信号,但是出于对中长期经济增长失速或者经济增长将重回老路的担忧,大盘先后击穿了2132点的前期低点和2000点重要关口,12月在十八大换届后政策红利预期及QFII资金介入对金融股的拉动下,打破大盘的弱势格局,一路向上,沪指全年收出小阳线。全年地产由于刚需带动的销售反转取得最大正收益,金融股由于低估值带动长期投资价值突显也取得明显正收益。

本基金总体保持对食品、医药等较高的配置,在上半年加大了煤炭、地产等低估值板块的配置,在3Q大幅减持了煤炭、有色、机械、汽车等相关周期性板块,但总体由于前期仓位较高,4季度食品板块中的白酒跌幅较大,全年业绩表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为0.782元,本报告期基金份额净值增长率为-3.22%,同期业绩比较基准收益率为7.09%,低于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2013年,美国的房地产复苏趋势明显,消费等数据逐步好转代表美国经济重回正常运转,而欧元区经济的起稳,欧元解体风险在逐渐消失,且继美国之后,日本采取更宽松的货币政策以推动经济,而国内2012年12月及2013年1月的出口数据好转均代表外围经济较2012年会明显好转。而国内经济在去年4Q明显体现出触底之势,目前仅看到房地产、汽车、家电等早周期可选消费品需求明显复苏,两会后是否投资能明显拉动对中游制造业和上游的需求将决定经济复苏的力度。

对A股而言,全年看由于今年外围经济企稳、海外流动性释放巨大,且国内目前经济温和企稳的可能性较大,企业的盈利随着PPI环比上升将回升明显,预计全年市场估值和盈利均向上提升的概率大,但春节前由于市场在政策改善及流动性改善预期下估值快速恢复,短期有调整的需求,未来推动大盘继续向上的动力将主要来自于实体经济回升带动的业绩提升。从风险看主要关注全球流动性释放充裕带来的通胀快速回升而带来的国内调控风险。

行业上我们仍将重仓受益于人口老龄化及城镇化的医药及大众消费股;看好受益于经济复苏及低估值的银行,受益于金融创新及市场向上带动盈利弹性的非银行金融;地产短期虽面临调整,但中期刚需及流动性充裕背景下仍将表现较好;而前期雾霾污染引发全国上下治理决心,环保股具备长期的投资机会。此外适应未来经济发展方向的成长股,细分行业中具有核心竞争优势、具备持续成长能力的个股仍将是我们重点投资的标的。

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、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、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,估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

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进行估值测算或者调整的投资品种;提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算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,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。

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

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在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议》的约定,对大成积极成长股票型证券投资基金基金管理人—大成基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31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

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,不存在损害基金份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 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

本托管人认为,大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证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成长股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告已经普华永道中天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。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	329,343,099.38	328,100,675.00
结算备付金	1,576,307.97	3,631,382.86
存出保证金	1,323,815.86	1,106,121.39
交易性金融资产	1,415,733,817.52	1,577,232,746.81
其中:股票投资	1,415,733,817.52	1,577,232,746.81
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	14,916,233.82	42,815,760.61
应收利息	76,687.19	57,009.38
应收股利	-	-
应收申购款	15,108.30	16,297.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	1,765,869,582.68	1,955,844,506.59
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	-	-
应付赎回款	41,555,287.76	318,195.26
应付管理人报酬	2,110,904.08	2,795,056.10
应付托管费	351,817.37	465,842.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,324,574.89	1,798,719.11
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,386,848.52	3,586,783.63
负债合计	49,729,432.62	8,964,596.77
所有者权益:		
实收基金	2,194,468,343.74	2,408,513,209.62
未分配利润	-478,328,193.68	-461,633,299.80
所有者权益合计	1,716,140,150.06	1,946,879,909.82
负债和所有者权益总计	1,765,869,582.68	1,955,844,506.59

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.782元,基金份额总额2,194,468,343.74份。

7.2 利润表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	-20,125,371.52	-766,402,696.23
1.利息收入	2,040,119.93	2,649,970.37
其中:存款利息收入	2,040,119.93	2,638,037.55
债券利息收入	-	11,932.82
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"-"填列)	-334,859,399.93	-191,925,984.60
其中:股票投资收益	-358,278,639.15	-218,066,108.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,647,693.50
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	23,419,239.22	24,492,430.02
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	312,649,705.22	-577,729,616.04
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	44,203.26	602,934.04
减:二、费用	41,913,683.93	65,202,450.92
1.管理人报酬	27,513,885.55	44,182,208.50
2.托管费	4,585,647.65	7,363,701.46
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,388,778.35	13,218,987.49
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	425,372.38	437,553.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-62,039,055.45	-831,605,147.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-62,039,055.45	-831,605,147.15

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	2,408,513,209.62	-461,633,299.80	1,946,879,909.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-62,039,055.45	-62,039,055.45
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)	-214,044,865.88	45,344,161.57	-168,700,704.31
其中:1.基金申购款	32,646,609.09	-6,587,394.68	26,059,214.41
2.基金赎回款	-246,691,474.97	51,931,556.25	-194,759,918.72
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(基金净值)	2,194,468,343.74	-478,328,193.68	1,716,140,150.06
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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)	-	-831,605,147.15	-831,605,147.15
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)	-546,730,364.63	54,544,233.38	-492,186,131.25
其中:1.基金申购款	344,954,056.98	10,203,903.76	355,157,960.74
2.基金赎回款	-891,684,421.61	44,340,329.62	-847,344,091.99
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)	2,408,513,209.62	-461,633,299.80	1,946,879,909.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

____王颢____　　____刘彩晖____　　____范瑛____
基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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相一致的说明

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相一致。

7.4.2 关联方关系

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	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	95,697,207.02	1.56%	85,867,746.13	1.01%

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31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	81,710.06	1.53%	25,837.00	1.11%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	72,135.20	1.02%	-	0.00%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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的净额列示。

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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,513,885.55	44,182,208.50
其中:支付销售机构的客户维护费	4,870,536.35	7,129,407.80

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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,585,647.65	7,363,701.46

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,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	34,573,260.00
期间申购/买入总份额	-	-
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	34,573,260.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.58%	1.44%

7.4.3.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.3.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	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	329,343,099.38	2,001,428.43	328,100,675.00	2,571,292.42

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万 科A	2012-12-26	公告重大事项	10.62	2013-1-21	11.13	8,033,327	68,413,955.25	85,313,932.74	-
000527	美的电器	2012-8-27	公告重大事项	9.69	-	-	3,399,871	43,095,949.73	32,944,749.99	-

注:本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,415,733,817.52	80.17
	其中:股票	1,415,733,817.52	80.17
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	330,919,407.35	18.74
6	其他各项资产	19,216,357.81	1.09
7	合计	1,765,869,582.68	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	36,600,000.00	2.13
B	采掘业	62,302,598.54	3.63
C	制造业	624,615,053.86	36.40
C0	食品、饮料	134,372,464.63	7.83
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	-	0.00
C5	电子	7,338,410.88	0.43
C6	金属、非金属	153,552,215.15	8.95
C7	机械、设备、仪表	144,127,351.47	8.40
C8	医药、生物制品	185,224,611.73	10.79
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	38,602,056.85	2.25
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	19,891,889.40	1.16
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	395,680,220.14	23.06
J	房地产业	217,475,590.35	12.67
K	社会服务业	15,526,408.38	0.90
L	传播与文化产业	5,040,000.00	0.29
M	综合类	-	0.00
	合计	1,415,733,817.52	82.50

8.3 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	601318	中国平安	2,007,253	90,908,488.37	5.30
2	000002	万 科A	8,033,327	85,313,932.74	4.97
3	600518	康美药业	6,000,000	78,840,000.00	4.59
4	600016	民生银行	8,999,827	70,738,640.22	4.12
5	600048	保利地产	5,094,078	69,279,460.80	4.04
6	601601	中国太保	2,500,000	56,250,000.00	3.28
7	600036	招商银行	3,940,000	54,175,000.00	3.16
8	601166	兴业银行	3,099,761	51,735,011.09	3.01
9	601628	中国人寿	2,162,372	46,274,760.80	2.70
10	000423	东阿阿胶	1,049,798	42,422,337.18	2.47

注:投资者欲了解本报告期末基金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.dcfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	102,631,274.47	5.27
2	601166	兴业银行	87,746,357.34	4.51
3	000568	泸州老窖	82,658,815.44	4.25
4	600585	海螺水泥	81,900,115.07	4.21
5	601318	中国平安	81,609,800.72	4.19
6	000002	万 科A	81,283,691.94	4.18
7	000858	五 粮 液	78,010,994.23	4.01
8	600036	招商银行	64,204,632.89	3.30
9	600362	江西铜业	61,219,539.31	3.14
10	002007	华兰生物	57,400,324.35	2.95
11	600298	安琪酵母	56,030,684.50	2.88
12	600048	保利地产	54,948,190.65	2.82
13	601699	潞安环能	54,289,490.47	2.79
14	600030	中信证券	49,136,633.57	2.52
15	600104	上汽集团	47,988,964.86	2.46
16	600557	康缘药业	45,892,481.43	2.36
17	600547	山东黄金	45,855,415.47	2.36
18	600519	贵州茅台	43,832,288.01	2.25
19	000527	美的电器	43,095,949.73	2.21
20	600395	盘江股份	43,009,380.75	2.21
21	000423	东阿阿胶	43,008,515.53	2.21
22	600549	厦门钨业	42,380,630.27	2.18
23	002230	科大讯飞	41,449,265.67	2.13
24	002482	广田股份	39,930,140.21	2.05
25	600111	包钢稀土	39,621,157.50	2.04
26	002024	苏宁电器	39,428,261.80	2.03
27	601628	中国人寿	39,137,109.04	2.01

注:本期累计买入金额指买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

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	600887	伊利股份	124,290,995.06	6.38
2	600406	国电南瑞	113,976,009.86	5.85
3	000858	五 粮 液	82,559,519.53	4.24
4	600079	人福医药	80,086,667.83	4.11
5	000826	桑德环境	78,954,578.13	4.06
6	600031	三一重工	76,226,000.25	3.92
7	000538	云南白药	69,952,234.64	3.59
8	600518	康美药业	68,799,795.29	3.53
9	600600	青岛啤酒	68,012,822.23	3.49
10	000423	东阿阿胶	66,644,899.89	3.42
11	000895	双汇发展	62,148,483.16	3.19
12	002007	华兰生物	60,566,382.20	3.11
13	000568	泸州老窖	60,536,039.82	3.11
14	600557	康缘药业	57,969,531.75	2.98
15	000581	威孚高科	56,068,442.00	2.88
16	600388	龙净环保	54,132,509.46	2.78
17	002230	科大讯飞	53,065,197.09	2.73
18	600547	山东黄金	49,409,020.26	2.54
19	600030	中信证券	47,605,516.59	2.45
20	600858	银座股份	47,129,445.67	2.42
21	600000	浦发银行	46,981,081.69	2.41
22	600298	安琪酵母	46,639,518.06	2.40
23	600036	招商银行	45,556,057.88	2.34
24	600549	厦门钨业	44,237,085.38	2.27
25	600585	海螺水泥	44,103,070.62	2.27
26	601166	兴业银行	43,353,022.45	2.23
27	600104	上汽集团	42,621,320.10	2.19

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	3,016,983,506.93
卖出股票收入(成交)总额	3,132,853,502.29

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。

8.5 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。

8.6 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持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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谴责、处罚的情形。

8.9.2 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股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,323,815.86
2	应收证券清算款	14,916,233.82
3	应收股利	-
4	应收利息	76,687.19
5	应收申购款	15,108.30
6	其他应收款	2,884,512.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,216,357.81

8.9.4 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债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	85,313,932.74	4.97	重大事项停牌

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
114,385	19,184.93	72,308,748.94	3.30%	2,122,159,594.80	96.70%

注:持有人户数为有效户数,即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	2,159.05	0.00010%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间:0;

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间:0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年1月16日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,408,513,209.62
本报告期基金总申购份额	32,646,609.09
减:本报告期基金总赎回份额	246,691,474.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,194,468,343.74

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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,本年度应支付的审计费用为101,000.00元。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
招商证券	3	859,695,554.93	13.99%	752,679.19	14.13%	-
英大证券	1	655,870,217.66	10.67%	560,471.80	10.52%	-
中信建投	3	622,244,821.94	10.13%	533,004.23	10.01%	-
瑞银证券	1	470,832,037.68	7.66%	413,328.06	7.76%	-
兴业证券	2	317,703,705.89	5.17%	279,006.85	5.24%	-
华泰证券	1	294,439,505.48	4.79%	243,693.79	4.58%	-
长城证券	2	277,305,084.87	4.51%	237,185.96	4.45%	-
平安证券	1	273,709,366.96	4.45%	241,313.40	4.53%	-
国盛证券	1	258,584,873.64	4.21%	210,101.61	3.94%	-
国金证券	2	230,037,319.77	3.74%	200,364.98	3.76%	-
红塔证券	1	216,347,811.29	3.52%	196,963.97	3.70%	-
华创证券	1	199,310,359.68	3.24%	166,364.66	3.12%	-
浙商证券	1	194,411,978.89	3.16%	161,681.73	3.04%	-
银河证券	3	161,770,368.06	2.63%	146,758.58	2.76%	-
上海证券	1	157,292,696.73	2.56%	143,198.92	2.69%	-
东北证券	1	145,618,861.95	2.37%	127,773.49	2.40%	-
民生证券	1	131,973,279.32	2.15%	120,148.80	2.26%	-
西部证券	1	109,034,468.00	1.77%	95,078.61	1.79%	-
海通证券	1	107,978,629.88	1.76%	95,550.06	1.79%	-
光大证券	2	95,697,207.02	1.56%	81,710.06	1.53%	-
方正证券	1	94,937,071.66	1.54%	82,723.74	1.55%	-
宏源证券	1	88,717,950.32	1.44%	78,506.67	1.47%	-
国泰君安	2	63,546,283.04	1.03%	56,231.95	1.06%	-
中金公司	2	49,065,767.72	0.80%	43,418.23	0.82%	-
北京高华	1	45,989,082.87	0.75%	39,090.82	0.73%	-
国信证券	1	17,189,765.70	0.28%	15,006.47	0.28%	-
安信证券	1	5,526,233.53	0.09%	4,697.26	0.09%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申银万国	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注:根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

(一)财务状况良好,最近一年无重大违规行为;

(二)经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;

(三)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;

(五)能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(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。

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《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加交易单元:中信建投。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

大成基金管理有限公司
2013年3月26日