大成沪深300指数证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年06月30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:2010年8月24日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")根据本基金合同规定,于2010年8月20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,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成沪深300指数
基金主代码	519300
前端交易代码	519300
后端交易代码	519301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月6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
报告期末基金份额总额	8,705,965,920.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金为指数基金,是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

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
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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现

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(2010年1月1日-2010年6月30日)
本期已实现收益	74,096,323.75
本期利润	-2,274,345,815.10
加权平均基金份额本期利润	-0.2980
本期基金份额净值增长率	-27.44%
3.1.2 期末数据和指标	本期末2010年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.2146
期末基金资产净值	6,837,669,746.06
期末基金份额净值	0.7854

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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
过去一个月	-7.09%	1.58%	-7.58%	1.67%	0.49%	-0.09%
过去三个月	-22.33%	1.72%	-23.39%	1.82%	1.06%	-0.10%
过去六个月	-27.44%	1.51%	-28.32%	1.59%	0.88%	-0.08%
过去一年	-19.24%	1.79%	-19.06%	1.90%	-0.18%	-0.11%
过去三年	-31.80%	2.29%	-31.91%	2.40%	0.11%	-0.11%
自基金合同生效起至今	91.04%	2.17%	132.32%	2.29%	-41.28%	-0.12%

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

注:按《基金合同》规定,本基金的初始建仓期为6个月。截至本报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之(六)投资组合中规定的各项比例。

§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,分别为中泰信托投资有限责任公司(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2010年6月30日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金,15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、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。

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		
杨丹先生	本基金基金经理	2006年5月27日	--	9年	理学硕士,2001年加入大成基金管理有限公司,先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部,长期从事指数化投资及金融工程研究工作。现兼任景福证券投资基金基金经理。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》、《大成沪深300指数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,大成沪深300指数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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》,公平对待旗下各投资组合,所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5日内、10日内)同向、反向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

在经历了2009年强劲的经济复苏以后,全球各主要经济体开始回归常态,中国经济也面临转型以及宽松货币政策的逐步退出。二季度以来,全球经济刺激政策退出预期高涨,过度宽松的流动性即将成为过去,但世界经济是否会"二次探底"的争论也不绝于耳。4月份后,欧洲4国债务危机的爆发,加剧了对世界经济复苏的担忧,投资者避险情绪高涨,全球资本市场均表现较差。沪深300指数由年初的3575点一路下行,最低下探2563点,指数点数跌去约1000点,跌幅高达28.32%,是全球股市表现最差的国家之一。

在2009年各项力度空前的"保增长"政策推动下,我国各项经济指标快速企稳回升,并在2010年一季度依然保持了良好的上升态势。在看到了一季度良好的经济数据以及开始上行的CPI指数后,国内政府经济调结构的力度更大。4月份针对房地产市场的严厉调控措施出台,房地产相关的产业链的股票大幅下跌,房地产、钢铁、建材等跌幅居前。由于担忧国内投资下行与海外经济再度下滑的风险,国内经济增速预期开始显著放缓,投资者开始抛弃与宏观经济相关度较高的金融、地产、煤炭、钢铁、建材等周期性行业,造成这些板块大幅下挫。而同时,相对受益于调结构的医药、大众消费品、节能减排、新技术等行业依然保持强势,市场分化十分明显。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。在本报告期间,本基金根据基金合同,严格依据指数化投资方法投资,较好的跟踪了指数,达到了基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金日均跟踪偏离度的绝对值为0.08%,年化跟踪误差为1.83%,符合本基金基金合同约定的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%、年度跟踪误差不超过4%的限制。截至报告期末,本基金份额净值为0.7854元,本报告期份额净值增长率为-27.44%,同期业绩比较基准增长率为-28.32%,略高于同期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

目前经济运行态势依然非常复杂。一方面,欧美经济复苏依然存在较大的不确定性,对国内出口造成较大压力;另一方面我国房地产投资势下滞较快,基建投资又受制于地方融资平台的坏账压力;因此,我国整体经济增速下滑将是一个确定性较高的情况。

从全球角度看,经济的长远发展趋势发生了较大变化,全球经济再平衡将是一个持续而漫长过程。以美国为首的发达经济体依靠过度消费维持增长的模式将很难重演。在这样的国际大环境下,中国的出口导向型经济必然转向以内需为主的经济发展模式。

从国内看,高依存度的外向型经济本身就是不安全的。劳动力成本上升、环境资源约束等因素要求我们转变原有的经济增长模式,这就意味着,以往固定资产投资高增长局面将会逐步改变,而内需、民生、消费,将成为未来较长时间内最重要的增长方式。

在全球经济再平衡和国内"调结构"的大背景下,我国未来几年的经济增速下滑是一个大概率事件,因此资本市场很难出现趋势性的整体机会,市场宽幅震荡的概率较大。

未来市场重点关注的方向依然要顺应调结构的产业转型趋势,与未来中国新的经济增长动力产业站在一起。

最需要重点关注的依然是医疗、民生、消费等领域,这是未来一个较长阶段可能涌现黑马的板块,将是一个长期的重点投资方向。中国的内需市场有巨大的容量,一旦某个产品、某一种服务类型的市场达到居民消费的阀值,那么行业将会迎来爆发性增长。

另外,也需要重点关注移动互联网、低碳节能行业等创新产业。这些行业符合未来国家经济转型的方向,行业发展空间巨大。这些行业的优质企业基数较小,具备良好的成长性,投资机会显著。

由于整体经济状况依然不差,而目前大盘蓝筹股估值并不高,流动性的收缩也是缓步渐进的过程,市场整体上不会有太大的风险。因此,估值较低的银行、保险、钢铁、建材、煤炭、工程机械等板块也将会有阶段性的表现,但很难出现趋势性上涨机会。

本基金将坚持被动型的指数化投资理念,继续深入研究更加高效的交易策略、风险控制方法,以期更好的跟踪指数,积极应对大额、频繁申购赎回及其他突发事件的影响,力争将跟踪误差控制在更低的水平,努力扮演好指数现货的角色。

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、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8名成员中包括两名基金经理及一名投资经理。

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。本基金已于2010年1月18日公告以截至2009年12月31日可供分配收益为基准,向本基金份额持有人进行收益分配,每10份基金份额派发现金红利0.90元,符合基金合同规定的分红比例。

§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

在托管大成沪深300指数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》等相关法律法规的规定以及《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》、《大成沪深300指数证券投资基金托管协议》的约定,对大成沪深300指数证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司2010年1月1日至2010年6月30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沪深300指数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 托管人对本半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沪深300指数证券投资基金半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。

中国农业银行股份有限公司
托管业务部
2010年8月20日

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成沪深300指数证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资产:		
银行存款	420,393,725.28	441,483,303.37
结算备付金	8,778,077.78	696,572.96
存出保证金	872,156.86	1,092,156.05
交易性金融资产	6,408,226,412.00	7,376,084,528.53
其中:股票投资	6,408,226,412.00	7,376,084,528.53
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	-	-
应收利息	76,757.54	89,897.66
应收股利	3,272,891.72	-
应收申购款	4,771,740.01	16,622,105.16
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,846,391,761.19	7,836,068,563.73
负债和所有者权益	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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	935,498.52	35,654,156.29
应付管理人报酬	4,472,390.51	4,841,301.29
应付托管费	894,478.11	968,260.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,708,846.25	2,131,410.01
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	710,801.74	751,604.01
负债合计	8,722,015.13	44,346,731.87
所有者权益:		
实收基金	8,705,965,920.19	6,636,407,974.83
未分配利润	-1,868,296,174.13	1,155,313,857.03
所有者权益合计	6,837,669,746.06	7,791,721,831.86
负债和所有者权益总计	6,846,391,761.19	7,836,068,563.73

截至2010年6月30日,基金份额净值0.7854元,基金份额总额8,705,965,920.19份。

6.2 利润表

会计主体:大成沪深300指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	-2,236,900,234.70	2,945,045,757.81
1.利息收入	1,611,878.23	1,404,641.85
其中:存款利息收入	1,604,734.69	1,095,625.46
债券利息收入	7,143.54	309,016.39
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)	108,961,188.59	-849,896,395.28
其中:股票投资收益	64,531,233.17	-889,984,642.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	85,048.46	-4,082.58
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	44,344,906.96	40,092,329.79
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-2,348,442,138.85	3,790,252,386.78
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	968,837.33	3,285,124.46
减:二、费用	37,445,580.40	30,082,439.84
1.管理人报酬	27,109,766.66	20,054,451.72
2.托管费	5,421,953.31	4,010,890.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,687,756.92	5,793,658.38
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	226,103.51	223,439.37
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-2,274,345,815.10	2,914,963,317.97
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,274,345,815.10	2,914,963,317.97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成沪深300指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	6,636,407,974.83	1,155,313,857.03	7,791,721,831.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,274,345,815.10	-2,274,345,815.10
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)	2,069,557,945.36	-134,496,152.19	1,935,061,793.17
其中:1.基金申购款	3,017,861,010.05	-126,439,388.33	2,891,421,621.72
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-948,303,064.69	-8,056,763.86	-956,359,828.55
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)	-	-614,768,063.87	-614,768,063.87
五、期末所有者权益(基金净值)	8,705,965,920.19	-1,868,296,174.13	6,837,669,746.06
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	7,397,235,977.87	-2,827,986,484.40	4,569,249,493.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,914,963,317.97	2,914,963,317.97
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)	-911,729,076.38	269,454,618.04	-642,274,458.34
其中:1.基金申购款	2,541,682,236.24	-354,183,966.68	2,187,498,269.56
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-3,453,411,312.62	623,638,584.72	-2,829,772,727.90
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)	6,485,506,901.49	356,431,451.61	6,841,938,353.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:王颖　　主管会计工作负责人:刘彩晖　　会计机构负责人:于雷

6.4 报表附注

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	与本基金的关系
大成基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
中泰信托投资有限责任公司("中泰信托")	基金管理人股东
光大证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金管理人股东

以下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 本报告期及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

无。

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的管理费	27,109,766.66	20,054,451.72
其中,应支付给销售机构的客户维护费	6,052,581.78	4,540,982.40

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.75%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的托管费	5,421,953.31	4,010,890.37

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/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前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

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

无。

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

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
基金合同生效日(2006年4月6日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	108,077,930	-
期间申购/买入总份额	-	108,077,930
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	108,077,930	108,077,930
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.24%	1.67%

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

无。

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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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	420,393,725.28	1,548,784.96	402,853,659.38	1,072,396.07

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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
601318	中国平安	10/6/29	资产重组	44.55	未定	-	4,640,169	232,386,854.12	206,719,528.95
000001	深发展A	10/6/30	资产重组	17.51	未定	-	4,934,433	92,275,572.42	86,401,921.83
600675	中华企业	10/5/17	重大事项	7.18	未定	-	1,330,020	12,827,929.19	9,549,543.60
600816	安信信托	10/6/2	重大事项	13.60	未定	-	468,845	8,072,140.92	6,376,292.00
000895	双汇发展	10/3/22	重大事项	43.57	未定	-	363,527	17,979,044.12	15,838,871.39

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本本报告期末无持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,408,226,412.00	93.60
	其中:股票	6,408,226,412.00	93.60
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	429,171,803.06	6.27
6	其他资产	8,993,546.13	0.13
7	合计	6,846,391,761.19	100.00

7.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	24,267,483.57	0.35
B	采掘业	687,865,928.41	10.06
C	制造业	1,869,769,904.26	27.35
C0	食品、饮料	274,558,642.15	4.02
C1	纺织、服装、皮毛	31,209,130.71	0.46
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	14,518,291.98	0.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	139,592,294.46	2.04
C5	电子	24,967,610.16	0.37
C6	金属、非金属	501,119,102.97	7.33
C7	机械、设备、仪表	620,680,577.90	9.08
C8	医药、生物制品	244,483,789.40	3.58
C99	其他制造业	18,640,464.53	0.27
D	电力、煤气及水的生产和供应业	222,112,615.53	3.25
E	建筑业	188,480,732.65	2.76
F	交通运输、仓储业	299,959,565.39	4.39
G	信息技术业	232,111,290.23	3.39
H	批发和零售贸易	216,973,794.61	3.17
I	金融、保险业	2,110,118,747.93	30.86
J	房地产业	358,735,928.24	5.25
K	社会服务业	61,513,038.06	0.90
L	传播与文化产业	19,912,470.80	0.29
M	综合类	116,404,912.32	1.70
	合计	6,408,226,412.00	93.72

7.3 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	600036	招商银行	20,249,084	263,440,582.84	3.85
2	601318	中国平安	4,640,169	206,719,528.95	3.02
3	601328	交通银行	33,557,351	201,679,679.51	2.95
4	600016	民生银行	30,642,033	185,384,299.65	2.71
5	601166	兴业银行	6,881,335	158,477,145.05	2.32
6	600000	浦发银行	11,179,950	152,047,320.00	2.22
7	600030	中信证券	11,383,318	133,184,820.60	1.95
8	601601	中国太保	5,164,926	117,605,365.02	1.72
9	601088	中国神华	5,283,419	116,076,715.43	1.70
10	000002	万 科A	15,559,131	105,490,908.18	1.54

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)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600036	招商银行	103,084,845.47	1.32
2	601328	交通银行	84,445,289.31	1.08
3	601166	兴业银行	76,064,385.99	0.98
4	601318	中国平安	70,275,891.80	0.90
5	600016	民生银行	66,388,088.01	0.85
6	600030	中信证券	58,779,625.77	0.75
7	601899	紫金矿业	56,961,002.49	0.73
8	600000	浦发银行	49,393,812.80	0.63
9	601668	中国建筑	46,683,686.60	0.60
10	601088	中国神华	39,981,725.27	0.51
11	601601	中国太保	37,021,741.81	0.48
12	000002	万 科A	36,151,563.64	0.46
13	601398	工商银行	29,574,723.04	0.38
14	000063	中兴通讯	29,484,906.59	0.38
15	601169	北京银行	28,255,753.88	0.36
16	600837	海通证券	28,247,336.87	0.36
17	600015	华夏银行	27,751,859.13	0.36
18	000001	深发展A	27,188,503.84	0.35
19	601618	中国中冶	26,026,819.72	0.33
20	600519	贵州茅台	25,666,176.49	0.33

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。

7.4.2 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	600036	招商银行	45,453,075.80	0.58
2	601318	中国平安	42,773,542.52	0.55
3	601328	交通银行	38,231,026.94	0.49
4	600016	民生银行	36,581,898.63	0.47
5	600030	中信证券	35,925,223.69	0.46
6	601166	兴业银行	32,911,625.65	0.42
7	000629	*ST钒钛	30,444,817.43	0.39
8	600000	浦发银行	25,003,921.05	0.32
9	601088	中国神华	24,606,172.08	0.32
10	000002	万 科A	22,269,281.02	0.29
11	601398	工商银行	17,485,374.17	0.22
12	601169	北京银行	17,268,247.71	0.22
13	600837	海通证券	17,038,920.03	0.22
14	000001	深发展A	16,113,188.21	0.21
15	601601	中国太保	15,240,635.11	0.20
16	600050	中国联通	13,745,039.96	0.18
17	600519	贵州茅台	13,050