大成积极成长股票型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年6月30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	2,816,064,751.75 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	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%(自2009年2月2日起,本基金的业绩比较基准变更为: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中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
本期已实现收益	-34,852,323.51
本期利润	-344,537,020.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1189
本期基金份额净值增长率	-11.50%
3.1.2 期末数据和指标	2010年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.0840
期末基金资产净值	2,579,641,665.56
期末基金份额净值	0.916

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
过去一个月	-5.66%	1.42%	-6.01%	1.33%	0.35%	0.09%
过去三个月	-8.86%	1.44%	-18.82%	1.46%	9.96%	-0.02%
过去六个月	-11.50%	1.25%	-22.72%	1.28%	11.22%	-0.03%
过去一年	-2.39%	1.69%	-14.43%	1.52%	12.04%	0.17%
过去三年	-10.27%	1.91%	-25.27%	1.91%	15.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	40.47%	1.93%	6.60%	1.91%	33.87%	0.02%

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: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。

§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		
周建春先生	本基金基金经理	2009年9月24日	--	13年	管理工程硕士,曾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、景博证券投资基金基金经理助理、景博证券投资基金基金经理、景福证券投资基金经理助理,现兼任大成策略回报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	--	3年	工商管理硕士,2007年7月加入大成基金有限公司从事研究工作,现任行业研究员。2009年10月起同时担任本基金和大成策略回报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

阶段	基金	净值增长率
过去六个月	大成积极成长股票型证券投资基金	-11.50%
	大成景阳领先股票型证券投资基金	-8.06%
	大成创新成长混合型证券投资基金	-19.05%

报告期内,大成积极成长股票型证券投资基金和大成创新成长混合型证券投资基金净值增长率差异为7.55%,其中4.96%来自行业配置,3.8%来自个股选择,-1.21%来自资产配置及其他因素。

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

2010上半年经济快速增长,呈现冲高回落态势,由于经济年初恢复较快,政府连续出台了调控房地产行业、提高存款准备金和严控银行信贷等系列措施,导致二季度经济增速明显放缓。从季度环比折年增长数据上看,GDP从一季度的12.2%下降至二季度6.3%;工业生产值同比增速也从年初1、2月的20.7%同比单月增速下滑至6月的13.7%,二季度的工业生产值季环比增长仅2%;先行指标PMI指数持续三个月下滑,7月份更是下降至51.2,接近收缩的临界点;同时发电量、规模以上工业企业增加值、央企利润及各主要行业的产销量,自4月以来增速均出现下降。总体来看国际金融危机影响的严重性和经济复苏的曲折性都超出预期,虽然经济基本面良好,不存在二次探底的可能性,但宏观调控面临的"两难"问题增多。

上半年证券市场表现与经济走势呈现高度相关性,一季度经济出现过热现象,市场在紧缩预期、流动性收缩的情况下,股指在区间小幅振荡,风格指数表现差异较大,结构分化明显,小市值股票表现好于大市值股票,稳定类行业表现好于周期性行业,新兴产业表现好于传统产业。二季度证券市场出现与经济同步的走势,股指快速回落,风格指数和行业板块均相继下跌,成交量不断萎缩,市场人气低迷,盈利变得非常困难,整体看低估值板块表现好于高估值板块。

本基金在年初加大了医药、食品饮料和新兴产业的配置力度,大幅降低了煤炭、地产等周期性行业配置;同时精选稳定成长型个股并坚定持有,二季度期末适当回补了部分低估值的周期性行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.916元,本报告期份额净值增长率为-11.50%,同期业绩比较基准增长率为-22.72%,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

欧洲在二季度暴出主权债务危机后,给全球经济复苏带来不确定性,为有效应对主权债务危机,欧洲各国只能推出财政紧缩方案,未来经济增长不确定性增加。美国的经济明显强于欧洲,但二季度实际GDP环比增长2.4%低于市场预期,就业市场目前失业率仍高达9.5%,改善低于预期;PMI先行指标在4月达到最高值60.4,后三个月环比持续下降至7月的55.5,说明尽管美国的增长仍在继续,但增长幅度放缓。基于各国政府对进一步实施刺激政策的意愿不强,对2011年经济增长将逐步加速的预期正面临着下行风险。外围经济的不确定增加了国内经济复苏的曲折性和宏观调控的难度。

对于我国经济中长期发展而言,由于投资和出口增速下降,下一轮经济周期的增长速度将适度放缓,经济增速回落到均衡水平,人民币升值和劳动力成本的提高将加速中国经济转型。因此,我们预期在经济转型过程中,市场难以出现系统性的大幅上涨,但由于当前市场整体估值水平偏低,也不存在系统性下跌的风险。短期而言,政府一直在保持经济平稳较快发展、调整经济结构和管理通胀预期三者之间寻找平衡,由于二季度GDP环比增速下滑过快,CPI也已出现环比负增长,我们预期下半年的宏观经济政策不会出现更加紧缩的调控措施,市场将出现反弹机会,但放松的力度将相对有限。从结构上看,稳定增长类行业和周期性行业相比吸引力接近,前期下跌幅度较大的低估值行业龙头公司会有较好表现。

上半年市场的下跌导致估值水平整体下移,大中市值股票估值水平较为合理,小市值股票估值水平较高,结构性泡沫依然存在,周期性行业在大幅下跌后估值水平有一定吸引力。促进经济结构、产业结构的调整是我国政府中长期发展的重要目标,我们坚定看好长期受益于经济转型的行业,将继续选择估值合理、业绩增长较为确定的行业及龙头公司作为主要投资标的,适当把握周期性行业的阶段性投资机会。对于2010年的市场环境,我们将风险控制和绝对收益放在投资的首位,加强自下而上的选股能力,努力获取良好的收益水平。

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0.05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积极成长股票型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:大成积极成长股票型证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

金额单位: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	497,166,844.85	192,838,900.09
结算备付金	2,282,017.12	9,558,677.81
存出保证金	1,558,308.75	2,731,889.35
交易性金融资产	2,116,229,098.95	2,980,598,247.38
其中:股票投资	2,116,229,098.95	2,980,598,247.38
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	-	35,837,283.15
应收利息	87,034.70	43,951.79
应收股利	-	-
应收申购款	545,153.64	78,437.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	2,620,752,970.65	3,224,571,899.28
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	25,778,997.35	13,858,886.76
应付赎回款	457,154.60	7,097,610.31
应付管理人报酬	3,379,385.35	4,022,840.41
应付托管费	563,230.89	670,473.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,811,546.73	10,484,940.26
应交税费	236,858.58	236,858.58
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,884,131.59	3,790,598.52
负债合计	41,111,305.09	40,162,208.23
所有者权益:		
实收基金	2,816,064,751.75	3,061,325,526.08
未分配利润	-236,423,086.19	123,084,164.97
所有者权益合计	2,579,641,665.56	3,184,409,691.05
负债和所有者权益总计	2,620,752,970.65	3,224,571,899.28

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.916元,基金份额总额2,816,064,751.75份。

6.2 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:2010年1月1日至2010年6月30日

金额单位: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	-311,917,800.37	1,195,490,909.42
1.利息收入	1,470,196.45	5,298,411.29
其中:存款利息收入	1,466,672.56	1,473,205.81
债券利息收入	3,523.89	3,825,205.48
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其它利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-3,761,803.34	-14,353,866.92
其中:股票投资收益	-10,119,329.22	-47,847,001.92
债券投资收益	13,071.81	10,755,450.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,344,454.07	22,737,685.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-309,684,697.20	1,204,409,184.34
4.其它收入(损失以"-"号填列)	58,503.72	137,180.71
减:二、费用	32,619,220.34	39,363,246.08
1.管理人报酬	21,345,965.68	21,816,550.61
2.托管费	3,557,660.96	3,636,091.73
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,501,095.74	13,689,514.98
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其它费用	214,497.96	221,088.76
三、利润总额	-344,537,020.71	1,156,127,663.34
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-344,537,020.71	1,156,127,663.34

6.3 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:2010年1月1日至2010年6月30日

金额单位: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)	3,061,325,526.08	123,084,164.97	3,184,409,691.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-344,537,020.71	-344,537,020.71
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)	-245,260,774.33	108,069.43	-245,152,704.90
其中:1.基金申购款	49,230,404.05	-662,012.98	48,568,391.07
2.基金赎回款	-294,491,178.38	770,082.41	-293,721,095.97
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)	-	-15,078,299.88	-15,078,299.88
五、期末所有者权益(基金净值)	2,816,064,751.75	-236,423,086.19	2,579,641,665.56
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)	3,817,667,707.13	-1,401,627,315.65	2,416,040,391.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,156,127,663.34	1,156,127,663.34
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)	-272,403,796.62	45,053,593.76	-227,350,202.86
其中:1.基金申购款	81,133,773.64	-16,378,115.27	64,755,658.37
2.基金赎回款	-353,537,570.26	61,431,709.03	-292,105,861.23
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)	3,545,263,910.51	-200,446,058.55	3,344,817,851.96

注: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

无。

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("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
中泰信托投资有限责任公司	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。

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

金额单位: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	
	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	641,965,567.92	13.52%	2,611,739,180.24	29.05%

6.4.3.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.3.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.3.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日			
	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	521,602.08	13.13%	2,635,075.28	38.69%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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	2,155,094.16	28.52%	2,155,094.16	19.02%

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

金额单位: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
当期发生的基金应支付的管理费	21,345,965.68	21,816,550.61
其中:支付给销售机构的客户维护费	3,837,068.92	3,844,811.69

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×1.5%/年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

金额单位: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
当期发生的基金应支付的托管费	3,557,660.96	3,636,091.73

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×0.25%/年天数。

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

本基金本会计期间及比较期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券或回购交易。

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
期初持有的基金份额	34,573,260.00	34,573,260.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
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	34,573,260.00	34,573,260.00
期末持有的基金份额占基金总份额的比例	1.23%	0.98%

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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

金额单位: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	497,166,844.85	1,439,242.33	301,775,186.85	1,426,079.51

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。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.3.7 其它关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项说明。

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

金额单位:人民币元

6.4.4.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600703	三安光电	09/09/30	1009/29	非公开发行	13.00	33.85	2,000,000	26,000,000.00	67,700,000.00	-
002024	苏宁电器	09/12/30	1012/31	非公开发行	11.47	11.40	2,250,000	25,800,000.00	25,650,000.00	-
002419	天虹商场	100521	100901	新股网下申购	40.00	34.19	63,590	2,543,600.00	2,174,142.10	-
002384	东山精密	100331	100709	新股网下申购	26.00	57.67	12,932	336,232.00	745,788.44	-
002383	合众思壮	100326	100702	新股网下申购	37.00	48.45	13,708	507,196.00	664,152.60	-
300073	当升科技	100416	1007/27	新股网下申购	36.00	58.75	8,488	305,568.00	498,670.00	-
002401	交技发展	100428	100806	新股网下申购	26.40	35.17	13,235	349,404.00	465,474.95	-
300071	华谊嘉信	100412	1007/21	新股网下申购	25.00	29.82	15,129	378,225.00	451,146.78	-

注:1、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

2、上述三安光电(600703)、苏宁电器(002024)认购价格及数量与2009年年度报告相比发生变动的原因是上述股票于2010年上半年进行了利润分配。

3、上述部分股票的可流通日期系根据上市公司的相关公告推算得出,具体可流通日期以上市公司后续公告为准。

6.4.4.2 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
000895	双汇发展	100322	重大事项停牌	43.57	未定	-	1,553,161	81,126,870.79	67,671,224.77	-
000001	深发展A	100630	重大资产重组	17.51	未定	-	3,499,881	72,820,281.18	61,282,916.31	-
601318	中国平安	100629	重大资产重组	44.55	未定	-	1,049,938	54,588,129.67	46,774,737.90	-

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 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。

6.4.4.3.2 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。

6.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

§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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,116,229,098.95	80.75
	其中:股票	2,116,229,098.95	80.75
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	499,448,861.97	19.06
6	其它各项资产	5,075,009.73	0.19
7	合计	2,620,752,970.65	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	49,516,344.17	1.92
B	采掘业	19,529,257.86	0.76
C	制造业	1,603,800,783.04	62.17
C0	食品、饮料	625,059,127.09	24.23
C1	纺织、服装、皮毛	18,213,534.00	0.71
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	78,207,705.40	3.03
C5	电子	54,428,760.78	2.11
C6	金属、非金属	66,865,787.54	2.59
C7	机械、设备、仪表	213,161,769.79	8.26
C8	医药、生物制品	535,478,787.96	20.76
C99	其它制造业	12,385,310.48	0.48
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,077,540.18	0.