大成精选增值混合型证券投资基金 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	大成精选增值混合
基金主代码	090004
基金交易代码	090004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年12月15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	3,428,879,815.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业,为投资者寻求持续稳定的投资收益。
投资策略	本基金利用大成基金自行开发的投资管理流程,采用"自上而下"资产配置和行业配置,"自下而上"精选股票的投资策略,主要投资于具有竞争力比较优势和长期增值潜力的行业和企业的股票,通过积极主动的投资策略,追求基金资产长期的资本增值。
业绩比较基准	新华富时中国A600指数×75%+新华富时中国国债指数×25%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,由于本基金采取积极的投资管理、主动的行业配置,使得本基金成为证券投资基金中风险程度中等偏高的基金产品,其长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。

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		400-888-5558	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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	-130,741,552.06
本期利润	-870,504,574.05
加权平均基金份额本期利润	-0.2512
本期基金份额净值增长率	-24.01%
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	0.2712
期末基金资产净值	2,715,249,121.88
期末基金份额净值	0.7919

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	-5.85%	1.47%	-5.87%	1.25%	0.02%	0.22%
过去三个月	-19.25%	1.66%	-17.19%	1.34%	-2.06%	0.32%
过去六个月	-24.01%	1.52%	-19.55%	1.18%	-4.46%	0.34%
过去一年	-11.36%	1.86%	-10.38%	1.40%	-0.98%	0.46%
过去三年	-14.73%	1.93%	-17.77%	1.79%	3.04%	0.14%
自基金合同生效起至今	256.71%	1.76%	117.85%	1.57%	138.86%	0.19%

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,本基金自基金合同生效起6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		
曹雄飞先生	本基金基金经理、研究部总监	2009年3月23日	--	9年	北京大学中国经济研究中心国际金融硕士。曾任职于招商证券北京地区总部、鹏华基金管理公司、景顺长城基金管理公司、大成基金管理公司、建信基金管理有限责任公司。曾担任行业研究员、宏观经济及投资策略研究员、市场销售和市场推广以及基金经理助理、基金经理等职,现兼任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
刘安田先生	本基金基金经理	2010年4月2日	--	7年	金融学硕士。曾任职于中国证券研究设计中心、友邦华泰基金管理公司、工银瑞信基金管理公司。曾担任行业研究员、宏观经济及策略研究员、基金经理助理。2008年8月加入大成基金,曾任大成基金管理有限公司研究部总监助理。具有基金从业资格。国籍:中国
孙蓓琳女士	本基金基金经理助理	2009年4月2日	--	6年	硕士,美国特许金融分析师(CFA)。曾任职银华基金管理有限公司,历任宏观经济研究员、石化行业研究员、交通运输行业研究员,2007年加入大成基金管理有限公司,任职交通运输、零售行业研究员,策略小组成员。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。

3、因工作需要,大成基金管理有限公司决定曹雄飞先生自2010年8月9日起不再担任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。大成精选增值混合型证券投资基金基金经理由刘安田先生单独担任。上述变更事项已于2010年8月10日公开披露。

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》、《大成精选增值混合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,大成精选增值混合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

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

2010年上半年市场整体呈现为弱势下跌,从风格上来说,中小盘股票表现优于大盘股。上证综指下跌26.8%,沪深300下跌28.3%,为国际主要市场中表现最差的市场之一。境外主要市场也没有延续一季度的震荡走势,二季度也出现了较大幅度的下跌。影响上半年境内市场表现的核心因素是政策,政策退出的节奏和力度都超出了市场此前的预期,重点体现在货币政策紧缩和房地产调控政策上。

在政策层面上,境内外都面临了一定的紧缩政策,境外政策紧缩更多地来自于被动的收缩,境内政策更多地是主动收缩。2009年各经济体超乎寻常的扩张政策在2010年就尝到了一些苦果,尤其是欧洲。欧洲强有力的财政刺激政策对于经济有一定的正面作用,但是公共部门在2010年就被投资者投以不信任票,欧元区必须要进行公共部门开支的收缩来应对投资者的担忧。中国经济的宏观调控政策则重点围绕"调结构、促民生"方面,具体体现在打压房地产行业、发展新兴产业、限制传统产业等三个方面的产业政策。与此同时,财政和货币方面的总量政策也呈现紧缩的态势。这一系列政策势必会造成经济的短期波动,至少资本市场是这样认为,6月份经济就开始出现明显的下滑。

在宏观经济层面上,各大经济体在二季度均出现了复苏放缓的迹象。欧洲主权债务危机使得欧洲经济复苏的进程放缓,而且投资者预期其未来几年内将会维持低速的增长。美国则呈现了"无就业、无通胀"的复苏态势,领先指标下滑、就业低于预期、财政刺激效应衰减等特征。中国经济则在货币和财政两方面的紧缩政策下,经济于2010年4月份就开始放缓。政府投资进度明显放缓,信贷的投放也受到较严格的控制。在一系列调控政策影响下,实体经济的参与者也对未来保持了谨慎的态度,企业生产与投资开始放缓,出现了一波去库存的经济波动。中国房地产和汽车两大消费市场也出现了明显的下滑,一线城市房地产销量重新回到了2008年的低点,汽车市场则迅速地出现了萎靡的状态。整体而言,二季度中国GDP环比增长预计只有6%左右,远低于一季度环比10%的增速。

我们在二季度的操作过程中采取一季度季报的策略,平衡了周期性与周期性的配置,但是由于行动不果断,没有给投资者带来较好的回报。

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0.7919元,本报告期份额净值增长率为-24.01%,同期业绩比较基准增长率为-19.55%,低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

展望2010年下半年,对于国际经济而言,我们认为美国经济复苏趋势明确,但欧元区债务危机增加了复苏的不确定性,各国经济复苏和增长速度将出现分化。欧洲经济在主权债务危机的冲击下,不得不"节衣缩食",未来几年内欧洲经济呈现低迷的态势。幸运的是,此次主权危机的传染性不强,欧洲的债券大部分被欧洲的商业银行所持有。最新的欧元区国家债券拍卖的情况表明,主权债务危机对于金融市场的冲击正在趋近尾声,但是我们不能因此放松其对于实体经济深远影响的警惕。

对于中国经济短期而言,经济内生的动力还很强,尤其是低端消费品的消费出现了量价齐升的局面。有三方面的理由促使我们认为中国经济的环比增速在三季度将会探底:①除了2008年外,中国经济还没有出现过连续两个季度的放缓;②汽车和房地产市场也显得有些超调;③中国信贷在4月份和5月份都略超预期,汽车的销量也有企稳的迹象,这两者往往都是先行指标。

中国宏观政策也出现了微妙的一些变化,温总理最近屡屡表达了宏观调控"两难"的担忧,高层也在密集地进行调研,表达了"经济调结构应该在较快经济增长基础之上"进行的看法。解铃还需系铃人,我们认为中国资本市场走出底部,也需要政策的密切配合。

在过去的几年中,我们已经充分地体会到市场的有效性,市场其实不仅走在实体经济前面,也很少落后于政策的变化。尽管市场很有可能存在"最后一跌",最后一跌的时时机很难预测。我们目前仍然维持攻守平衡的态势,随着经济趋势的明朗,我们会采取积极的配置,把握中国经济的发展方向,持有中国经济长期受益的品种,波段操作政策放松带来的交易性品种。

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0.85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

在托管大成精选增值混合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》等相关法律法规的规定以及《大成精选增值混合型证券投资基金基金合同》、《大成精选增值混合型证券投资基金托管协议》的约定,对大成精选增值混合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精选增值混合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精选增值混合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:大成精选增值混合型证券投资基金
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	472,461,548.03	222,910,748.95
结算备付金	6,818,147.81	9,950,864.59
存出保证金	4,606,411.05	2,506,907.53
交易性金融资产	2,249,687,033.40	3,679,692,456.93
其中:股票投资	2,249,687,033.40	3,679,692,456.93
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	-	186,433.42
应收利息	72,244.89	56,770.91
应收股利	-	-
应收申购款	893,648.41	32,497,746.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,734,539,033.59	3,947,801,928.69
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	7,247,592.99	2,273,633.34
应付赎回款	874,681.20	8,774,216.66
应付管理人报酬	3,579,480.26	4,896,845.91
应付托管费	596,580.04	816,141.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,784,951.18	7,932,643.97
应交税费	6,600.00	6,600.00
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	1,200,026.04	1,124,727.46
负债合计	19,289,911.71	25,824,808.35
所有者权益:		
实收基金	1,785,415,117.35	1,809,577,378.30
未分配利润	929,834,004.53	2,112,399,742.04
所有者权益合计	2,715,249,121.88	3,921,977,120.34
负债和所有者权益总计	2,734,539,033.59	3,947,801,928.69

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.7919元,基金份额总额3,428,879,815.67份。

6.2 利润表

会计主体:大成精选增值混合型证券投资基金
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	-825,565,469.49	1,181,170,908.72
1. 利息收入	1,751,381.00	3,967,604.90
其中:存款利息收入	1,423,478.53	1,127,707.68
债券利息收入	1,761.85	2,839,897.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	326,140.62	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以"-"填列)	-88,009,902.49	520,328,385.77
其中:股票投资收益	-100,020,283.44	487,782,829.04
基金投资收益		-
债券投资收益	22,188.25	13,351,821.64
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	11,988,192.70	19,193,735.09
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-739,763,021.99	656,552,238.94
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5. 其他收入(损失以"-"号填列)	456,073.99	322,679.11
减:二、费用	44,939,104.56	40,650,776.64
1. 管理人报酬	24,057,473.97	20,590,733.03
2. 托管费	4,009,578.99	3,431,788.86
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,642,122.09	16,394,665.39
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	229,929.51	233,589.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-870,504,574.05	1,140,520,132.08
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-870,504,574.05	1,140,520,132.08

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成精选增值混合型证券投资基金
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)	1,809,577,378.30	2,112,399,742.04	3,921,977,120.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-870,504,574.05	-870,504,574.05
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)	-24,162,260.95	-23,094,455.51	-47,256,716.46
其中:1.基金申购款	206,593,669.43	175,725,363.32	382,319,032.75
2.基金赎回款	-230,755,930.38	-198,819,818.83	-429,575,749.21
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)	-	-288,966,707.95	-288,966,707.95
五、期末所有者权益(基金净值)	1,785,415,117.35	929,834,004.53	2,715,249,121.88
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)	1,825,134,656.05	423,453,084.55	2,248,587,740.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,140,520,132.08	1,140,520,132.08
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)	104,715,961.31	91,893,733.38	196,609,694.69
其中:1. 基金申购款	304,289,544.19	209,308,626.46	513,598,170.65
2. 基金赎回款	-199,573,582.88	-117,414,893.08	-316,988,475.96
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)	1,929,850,617.36	1,655,866,950.01	3,585,717,567.37

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相一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 本报告期存在其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

本报告期内未存在其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

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、注册登记机构、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	1,570,988,200.56	14.58%	1,240,668,483.90	11.26%

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 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	1,276,442.16	14.19%	23,632.17	0.41%
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	1,008,053.16	10.92%	953,966.19	10.22%

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。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

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	24,057,473.97	20,590,733.03
其中:支付给销售机构的客户维护费	2,641,233.20	2,295,427.34

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。

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
当期发生的基金应支付的托管费	4,009,578.99	3,431,788.86

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。

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(2004年12月15日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	34,931,299.49	-
期间申购/买入总份额	-	34,931,299.49
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	34,931,299.49	34,931,299.49
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.02%	0.94%

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	472,461,548.03	1,356,974.41	163,064,349.24	1,061,862.44

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

无。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

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

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
002383	合众思壮	10/3/26	10/7/2	新股网下申购	37.00	48.45	13,708	507,196.00	664,152.60	
002384	东山精密	10/3/31	10/7/9	新股网下申购	26.00	57.67	12,932	336,232.00	745,788.44	
002401	交技发展	10/4/28	10/8/6	新股网下申购	26.40	35.17	15,369	405,741.60	540,527.73	
002419	天虹商场	10/5/21	10/9/1	新股网下申购	40.00	34.19	53,062	2,122,480.00	1,814,189.78	
002433	皮宝制药	10/6/4	10/9/20	新股网下申购	29.82	27.18	37,636	1,122,305.52	1,022,946.48	
300070	碧水源	10/4/12	10/7/21	新股网下申购	69.00	93.20	8,469	584,361.00	789,310.80	
300073	当升科技	10/4/16	10/7/27	新股网下申购	36.00	58.75	12,733	458,388.00	748,063.75	

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。2.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
601318	中国平安	10/6/29	资产重组	44.55	未定	-	2,499,908	115,381,434.72	111,370,901.40	

注:本基金截至2010年6月30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。

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。

§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	2,249,687,033.40	82.27
	其中:股票	2,249,687,033.40	82.27
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	479,279,695.84	17.53
6	其他资产	5,572,304.35	0.20
7	合计	2,734,539,033.59	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	-	0.00
B	采掘业	113,919,403.44	4.20
C	制造业	1,342,450,771.73	49.44
C0	食品、饮料	382,594,681.52	14.09
C1	纺织、服装、皮毛	64,415,256.00	2.37
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	94,860,690.89	3.49
C5	电子	39,623,021.40	1.46
C6	金属、非金属	57,276,821.84	2.11
C7	机械、设备、仪表	368,739,398.27	13.58
C8	医药、生物制品	266,545,452.65	9.82
C99	其他制造业	68,395,449.16	2.52
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,077,540.18	0.08
E	建筑业	20,860,000.00	0.77
F	交通运输、仓储业	98,489,836.94	3.63
G	信息技术业	109,305,627.10	4.03
H	批发和零售贸易	207,508,687.35	7.64
I	金融、保险业	287,415,855.86	10.59
J	房地产业	36,180,000.00	1.33
K	社会服务业	31,479,310.80	1.16
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	2,249,687,033.40	82.85

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	600132	重庆啤酒	4,000,000	144,000,000.00	5.30
2	601318	中国平安	2,499,908	111,370,901.40	4.10
3	600267	海正药业	3,290,311	82,751,321.65	3