

大成沪深 300 指数证券投资基金  
2011 年半年度报告

2011 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：2011 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2011 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	7
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	9
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.....	10
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>23</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	23
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	23
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	24
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 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.....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	33
7.8 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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>34</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>34</b>

<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>35</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
10.2 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.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	35
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	35
10.8 其他重大事件.....	38
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>39</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>39</b>
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金
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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,872,232,728.74 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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张树忠	项俊波

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## § 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	报告期( 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-15,025,769.87
本期利润	-91,204,023.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0109
本期加权平均净值利润率	-1.16%
本期基金份额净值增长率	-2.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-607,413,664.90
期末可供分配基金份额利润	-0.0772
期末基金资产净值	7,264,819,063.84
期末基金份额净值	0.9228
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	124.47%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）

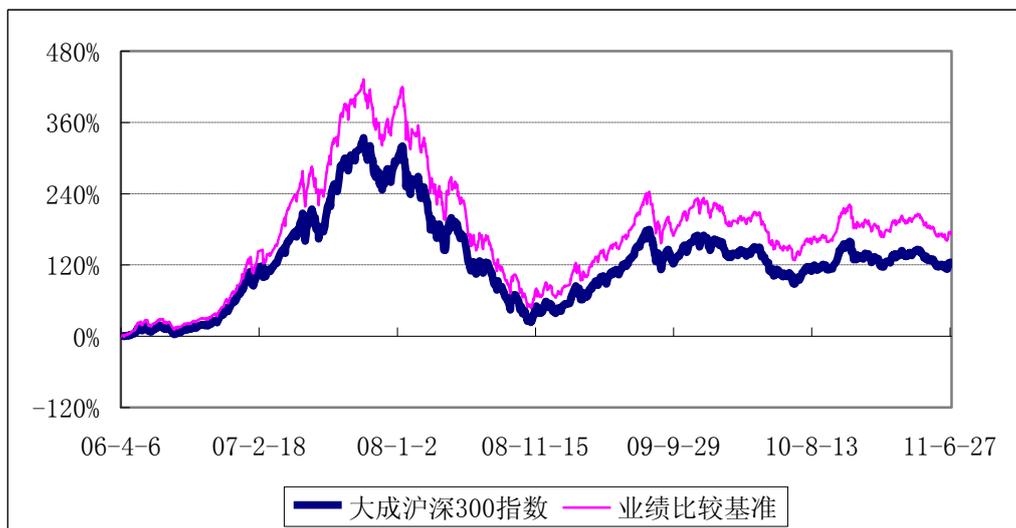
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	1.91%	1.12%	1.42%	1.19%	0.49%	-0.07%
过去三个月	-4.80%	1.03%	-5.56%	1.10%	0.76%	-0.07%
过去六个月	-2.37%	1.16%	-2.69%	1.23%	0.32%	-0.07%
过去一年	17.49%	1.33%	18.77%	1.40%	-1.28%	-0.07%
过去三年	6.12%	1.93%	9.04%	2.02%	-2.92%	-0.09%
自基金合同生效起至今	124.47%	2.04%	175.92%	2.15%	-51.45%	-0.11%

### 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2011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，1只ETF及1只ETF联接基金：深证成长40ETF及大成深证成长40ETF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17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和大成内需增长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	2011 年 6 月 14 日	10 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。2006 年 5 月 27 日开始担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2008 年 8 月 23 日开始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。
胡琦先生	本基金基金经理	2011 年 6 月 15 日	--	8 年	博士。2003 年 3 月至 2008 年 7 月就职于财富证券有限责任公司，历任研发中心研究员、战略规划部副总经理以及金融工程部主管投资副总经理；2008 年 8 月至 2010 年 10 月在深圳证券交易所博士后工作站从事研究工作。2010 年 10 月加入大成基金管理有限公司。2011 年 5 月 18 日开始担任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2011 年 6 月 15 日开始兼任大成沪深 300 指数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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据各基金合同，目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

#### 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

第二季度的宏观经济指标显示经济运行强化了一季度的走势。CPI 迭创新高，GDP 增速下降趋势更为明确，经济滞涨已经出现。通常在经济滞涨期间，许多经济问题很容易向社会问题转化。尤其是 7.23 动车事故，引发市场从单纯关注固定资产投资的“量”，转而兼顾固定资产投资的“质”。固定资产投资不再单纯是一个经济问题，同样也成为社会问题。该事件的出现将大大增加市场对保障房建设、地方融资平台等问题关注，这些都将考验我国政府在推动经济增长方式转型中的决策智慧。

与去年的走势相左，今年上半年大盘蓝筹股较小盘股表现出较好的抗跌性。截止 6 月 30 日，市场全部 A 股的平均静态 PE 为 18.25 倍，沪深 300 指数的 PE 为 14.53 倍，市场整体估值水平已经处于合理区域。随着中报业绩披露的临近，部分超跌的小盘股开始活跃，被错杀的小盘股和低估值的蓝筹股有望重新走上价值回归的道路。值得关注的是，二季度诸如双汇发展、伊利股份、华兰生物等白马股先后爆出了诚信危机，中国在美国的上市公司也集体遭遇诚信质疑。这在相当程度上折射出我国一批优秀的企业正在经历发展理念与模式的转型，这种转型难免经历阵痛。沪深 300 指数的样本股多为市场优质蓝筹股，随着投资理念、资金以及市场的全球化，中长期来看，这类股票最有可能获得估值溢价。

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，较好地跟踪了指数，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 0.06%，年度跟踪误差为 1.21%，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。本基金份额净值为 0.9228 元，本报告份额净值增长率为-2.37%，同期业绩比较基准增长率为-2.69%，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

“一高一低（全面高通胀和 GDP 增速降低）”是当前经济运行最显著的二个特征，其对应的是调控高通胀和有效启动内需之间的矛盾。解决和缓解这一矛盾将成为我国经济转型最重要的课题，而寻求答案的思路更多地需要从生产环节转向分配环节。海外方面，美国国债高筑和财政赤字的交困将美元推入尴尬的境地，这一困境将最终对美国居民现有的消费模式产生冲击，其影响是深远的。未来美国经济与美元政治的关联度很可能会显著提高。欧洲经济体内部的和谐不断被希腊等国家打破，除德、法之外，其他欧盟国家经济状况堪忧，在未来一段时期里，“维稳”是欧盟最为艰巨的任务。

经过二季度的大幅调整后，市场估值层面已经合理。短期内，从紧的宏观政策很难出现实质性的转变，资金层面受制于调控预期的影响，增量资金大规模入场的概率不大，小市值股票对存量资金的变动更为敏感。当前中小上市公司手握大笔首募资金和超募资金，相比中小非上市公司的融资难，明显的资金优势有助于提升其竞争优势与经营业绩。考虑到三季度 CPI 冲高回落的概

率较大，政策进一步从紧的调控预期有望得以缓和，市场逐渐企稳的概率在增大。

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，为投资者提供专业化服务。

#### 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 名成员中包括两名投资组合经理。

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—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》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 2011 年 1 月 1 日至 2011 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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告(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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.2.1	388,122,589.76	475,489,241.18
结算备付金		5,899,088.20	317,977.19
存出保证金		1,030,975.91	566,195.63
交易性金融资产	6.4.2.2	6,856,290,419.36	8,076,011,542.35
其中：股票投资		6,856,290,419.36	8,073,253,779.58
基金投资		-	-
债券投资		-	2,757,762.77
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		54,742,681.50	-
应收利息	6.4.2.5	70,615.25	95,412.01
应收股利		8,887,846.69	-
应收申购款		961,297.75	1,512,605.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		7,316,005,514.42	8,553,992,974.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		41,602,636.62	-
应付赎回款		1,271,614.02	2,300,781.13
应付管理人报酬		4,360,775.15	5,527,295.67

应付托管费		872,155.01	1,105,459.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	2,367,764.00	1,436,190.47
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	711,505.78	623,454.18
负债合计		51,186,450.58	10,993,180.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.2.9	7,872,232,728.74	9,038,687,823.51
未分配利润	6.4.2.10	-607,413,664.90	-495,688,029.94
所有者权益合计		7,264,819,063.84	8,542,999,793.57
负债和所有者权益总计		7,316,005,514.42	8,553,992,974.16

注：截至 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9228 元，基金份额总额 7,872,232,728.74 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-47,894,992.35	-2,236,900,234.70
1. 利息收入		1,683,336.21	1,611,878.23
其中：存款利息收入	6.4.2.11	1,651,834.14	1,604,734.69
债券利息收入		31,502.07	7,143.54
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）		24,096,955.66	108,961,188.59
其中：股票投资收益	6.4.2.12	-39,401,649.40	64,531,233.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	2,234,029.66	85,048.46
资产支持证券投资收益	6.4.2.14	-	-
衍生工具收益	6.4.2.15	-	-
股利收益	6.4.2.16	61,264,575.40	44,344,906.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	-76,178,254.03	-2,348,442,138.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.18	2,502,969.81	968,837.33
<b>减：二、费用</b>		43,309,031.55	37,445,580.40
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	29,455,249.56	27,109,766.66

2. 托管费	6. 4. 5. 2. 2	5, 891, 049. 92	5, 421, 953. 31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 2. 19	7, 739, 651. 78	4, 687, 756. 92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6. 4. 2. 20	223, 080. 29	226, 103. 51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-91, 204, 023. 90</b>	<b>-2, 274, 345, 815. 10</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-91, 204, 023. 90</b>	<b>-2, 274, 345, 815. 10</b>

### 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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	9, 038, 687, 823. 51	-495, 688, 029. 94	8, 542, 999, 793. 57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-91, 204, 023. 90	-91, 204, 023. 90
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）	-1, 166, 455, 094. 77	-20, 521, 611. 06	-1, 186, 976, 705. 83
其中：1. 基金申购款	1, 322, 247, 389. 60	-69, 791, 888. 20	1, 252, 455, 501. 40
2. 基金赎回款	-2, 488, 702, 484. 37	49, 270, 277. 14	-2, 439, 432, 207. 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）	7, 872, 232, 728. 74	-607, 413, 664. 90	7, 264, 819, 063. 84
项目	上年度可比期间 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	-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

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：王颢                      主管会计工作负责人：刘彩晖                      会计机构负责人：范瑛

#### 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 重要财务报表项目的说明

###### 6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	388,122,589.76
定期存款	-
其他存款	-
合计：	388,122,589.76

###### 6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,961,613,765.01	6,856,290,419.36	-105,323,345.65
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,961,613,765.01	6,856,290,419.36	-105,323,345.65

**6.4.2.3 衍生金融资产/负债**

无余额。

**6.4.2.4 买入返售金融资产**

无余额。

**6.4.2.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	68,226.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,389.14
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	70,615.25

**6.4.2.6 其他资产**

无余额。

**6.4.2.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,367,764.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,367,764.00

**6.4.2.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	3,230.89
预提费用	208,274.89
合计	711,505.78

**6.4.2.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,038,687,823.51	9,038,687,823.51

本期申购	1,322,247,389.60	1,322,247,389.60
本期赎回(以“-”号填列)	-2,488,702,484.37	-2,488,702,484.37
本期末	7,872,232,728.74	7,872,232,728.74

**6.4.2.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	837,355,996.74	-1,333,044,026.68	-495,688,029.94
本期利润	-15,025,769.87	-76,178,254.03	-91,204,023.90
本期基金份额交易产生的变动数	-95,866,455.30	75,344,844.24	-20,521,611.06
其中：基金申购款	118,759,254.69	-188,551,142.89	-69,791,888.20
基金赎回款	-214,625,709.99	263,895,987.13	49,270,277.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	726,463,771.57	-1,333,877,436.47	-607,413,664.90

**6.4.2.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	1,629,656.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,466.52
其他	9,711.47
合计	1,651,834.14

**6.4.2.12 股票投资收益**
**6.4.2.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	2,896,660,289.61
减：卖出股票成本总额	2,936,061,939.01
买卖股票差价收入	-39,401,649.40

**6.4.2.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	25,576,642.90
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	23,309,700.00
减：应收利息总额	32,913.24
债券投资收益	2,234,029.66

**6.4.2.14 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.2.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.2.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	61,264,575.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,264,575.40

**6.4.2.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-76,178,254.03
——股票投资	-75,567,191.26
——债券投资	-611,062.77
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-76,178,254.03

**6.4.2.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,502,969.81
合计	2,502,969.81

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**6.4.2.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,739,651.78
银行间市场交易费用	-
合计	7,739,651.78

**6.4.2.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,767.52
银行费用	5,805.40
债券帐户维护费	9,000.00
合计	223,080.29

**6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明**
**6.4.3.1 或有事项**

无。

**6.4.3.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.4 关联方关系**

**6.4.4.1 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。

**6.4.4.2 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、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	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	基金管理人股东

注：1、中国国证监会于 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、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.5.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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	361,511,804.55	7.73%	-	0.00%

**6.4.5.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
光大证券	1,246,424.50	4.87%	-	0.00%

**6.4.5.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.5.1.4 权证交易**

无。

**6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	295,528.48	7.52%	295,528.48	12.48%
关联方名称	上年度可比期间 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	-	0.00%	-	0.00%

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和经手费后的净额列示。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。

#### 6.4.5.2 关联方报酬

##### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月 30日	2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,455,249.56	27,109,766.66
其中：支付销售机构的客户维护费	5,693,243.57	6,052,581.78

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：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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。

##### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月 30日	2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,891,049.92	5,421,953.31

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：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

**6.4.5.4.1 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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 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	108,077,930.00	108,077,930.00
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	108,077,930.00	-
期末持有的基金份额	-	108,077,930.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.24%

注：基金管理人赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

**6.4.5.4.2 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。

**6.4.5.5 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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 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	388,122,589.76	1,629,656.15	420,393,725.28	1,548,784.96

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。

**6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.5.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.6 利润分配情况**

无。

**6.4.7 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**
**6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.7.2 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
601998	中信银行	2011 年 6 月 29 日	配股事项	4.75	2011 年 7 月 7 日	4.59	2,937,827	20,694,043.59	13,954,678.25	-
000652	泰达股份	2010 年 11 月 19 日	资产重组	7.68	2011 年 7 月 8 日	7.68	1,467,393	17,679,765.41	11,269,578.24	-
600216	浙江	2011 年 6	非公开	31.39	2011 年 7 月 4	32.60	341,106	10,274,964.18	10,707,317.34	-

	医药	月 27 日	发行股 票融资		日					
000876	新希 望	2011 年 6 月 29 日	资产重 组	19.95	2011 年 7 月 5 日	21.95	531,131	6,231,936.86	10,596,063.45	-
600170	上海 建工	2011 年 6 月 29 日	资产重 组	15.59	2011 年 7 月 4 日	16.25	532,056	6,702,661.09	8,294,753.04	-
000959	首钢 股份	2010 年 10 月 29 日	资产重 组	4.42	未知	未知	1,836,456	10,390,203.70	8,117,135.52	-
600369	西南 证券	2011 年 3 月 1 日	重大事 项	11.87	2011 年 8 月 16 日	12.49	672,231	11,035,142.53	7,979,381.97	-

#### 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.8 金融工具风险及管理

##### 6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、金融工程部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。金融工程部履行风险量化评估分析职责。

##### 6.4.8.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到年本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.8.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.8.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产								
银行存款	388,122,589.76	-	-	-	-	-	-	388,122,589.76
结算备付金	5,899,088.20	-	-	-	-	-	-	5,899,088.20
存出保证金	-	-	-	-	-	-	1,030,975.91	1,030,975.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	6,856,290,419.36	6,856,290,419.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	54,742,681.50	54,742,681.50
应收利息	-	-	-	-	-	-	70,615.25	70,615.25
应收股利	-	-	-	-	-	-	8,887,846.69	8,887,846.69
应收申购款	36,140.93	-	-	-	-	-	925,156.82	961,297.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	394,057,818.89	-	-	-	-	-	6,921,947,695.53	7,316,005,514.42
负债								
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	41,602,636.62	41,602,636.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	1,271,614.02	1,271,614.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	4,360,775.15	4,360,775.15
应付托管费	-	-	-	-	-	-	872,155.01	872,155.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	2,367,764.00	2,367,764.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	711,505.78	711,505.78
负债总计	-	-	-	-	-	-	51,186,450.58	51,186,450.58
利率敏感度缺口	394,057,818.89	-	-	-	-	-	6,870,761,244.95	7,264,819,063.84
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产								
银行存款	475,489,241.18	-	-	-	-	-	-	475,489,241.18
结算备付金	317,977.19	-	-	-	-	-	-	317,977.19
存出保证金	-	-	-	-	-	-	566,195.63	566,195.63
交易性金融资产	-	-	2,757,762.77	-	-	-	8,073,253,779.58	8,076,011,542.35
应收利息	-	-	-	-	-	-	95,412.01	95,412.01

应收申购款	42,970.06	-	-	-	-	1,469,635.74	1,512,605.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	475,850,188.43	-2,757,762.77	-	-	-	-8,075,385,022.96	8,553,992,974.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,300,781.13	2,300,781.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,527,295.67	5,527,295.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,105,459.14	1,105,459.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,436,190.47	1,436,190.47
其他负债	-	-	-	-	-	623,454.18	623,454.18
负债总计	-	-	-	-	-	10,993,180.59	10,993,180.59
利率敏感度缺口	475,850,188.43	-2,757,762.77	-	-	-	-8,064,391,842.37	8,542,999,793.57

#### 6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值为零，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.8.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.8.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2011 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,856,290,419.36	94.38	8,073,253,779.58	94.50
交易性金融资产—基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产—债券投资	-	0.00	2,757,762.77	0.03
衍生金融资产—权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	6,856,290,419.36	94.38	8,076,011,542.35	94.53

#### 6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	341,820,000.00	404,986,811.55
	沪深 300 指数下降 5%	-341,670,000.00	-405,504,041.15

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 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	6,856,290,419.36	93.72
	其中：股票	6,856,290,419.36	93.72
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	394,021,677.96	5.39
6	其他各项资产	65,693,417.10	0.90
7	合计	7,316,005,514.42	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	40,082,388.01	0.55
B	采掘业	805,192,407.62	11.08
C	制造业	2,513,619,844.92	34.60
C0	食品、饮料	418,939,494.19	5.77
C1	纺织、服装、皮毛	23,519,426.49	0.32
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	170,200,237.32	2.34
C5	电子	76,384,836.72	1.05

C6	金属、非金属	625,738,958.31	8.61
C7	机械、设备、仪表	911,515,255.79	12.55
C8	医药、生物制品	275,169,132.66	3.79
C99	其他制造业	12,152,503.44	0.17
D	电力、煤气及水的生产和供应业	149,518,830.17	2.06
E	建筑业	220,718,802.49	3.04
F	交通运输、仓储业	254,888,727.46	3.51
G	信息技术业	218,346,779.74	3.01
H	批发和零售贸易	207,752,975.96	2.86
I	金融、保险业	1,901,205,760.32	26.17
J	房地产业	323,631,240.18	4.45
K	社会服务业	57,596,191.69	0.79
L	传播与文化产业	14,011,081.16	0.19
M	综合类	149,725,389.64	2.06
	合计	6,856,290,419.36	94.38

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	16,177,856	210,635,685.12	2.90
2	601318	中国平安	4,045,879	195,294,579.33	2.69
3	600016	民生银行	27,275,621	156,289,308.33	2.15
4	601328	交通银行	25,134,964	139,247,700.56	1.92
5	600000	浦发银行	13,514,931	132,986,921.04	1.83
6	601166	兴业银行	9,117,559	122,904,695.32	1.69
7	601088	中国神华	3,982,658	120,037,312.12	1.65
8	600030	中信证券	8,406,900	109,962,252.00	1.51
9	601939	建设银行	21,989,693	108,629,083.42	1.50
10	000002	万科A	11,689,312	98,774,686.40	1.36
11	600519	贵州茅台	455,788	96,914,202.44	1.33
12	600837	海通证券	9,935,429	89,617,569.58	1.23
13	601601	中国太保	3,795,699	84,985,700.61	1.17
14	601398	工商银行	18,436,311	82,225,947.06	1.13
15	000858	五粮液	2,291,876	81,865,810.72	1.13
16	601668	中国建筑	18,113,175	72,996,095.25	1.00
17	000776	广发证券	1,801,996	70,728,343.00	0.97
18	600585	海螺水泥	2,414,911	67,037,929.36	0.92
19	600031	三一重工	3,667,816	66,167,400.64	0.91
20	002024	苏宁电器	5,068,909	64,932,724.29	0.89
21	600111	包钢稀土	877,385	62,671,610.55	0.86

22	601006	大秦铁路	7,180,957	58,812,037.83	0.81
23	000001	深发展 A	3,366,624	57,468,271.68	0.79
24	000651	格力电器	2,381,834	55,973,099.00	0.77
25	000157	中联重科	3,497,700	53,794,626.00	0.74
26	600050	中国联通	10,238,321	53,751,185.25	0.74
27	601169	北京银行	5,264,027	52,482,349.19	0.72
28	601857	中国石油	4,537,249	49,410,641.61	0.68
29	000063	中兴通讯	1,696,888	47,987,992.64	0.66
30	600048	保利地产	4,309,681	47,363,394.19	0.65
31	601899	紫金矿业	6,361,278	46,055,652.72	0.63
32	000983	西山煤电	1,902,520	46,040,984.00	0.63
33	601989	中国重工	3,320,913	45,795,390.27	0.63
34	000792	盐湖股份	768,119	45,319,021.00	0.62
35	000527	美的电器	2,452,021	45,092,666.19	0.62
36	600900	长江电力	5,977,354	43,096,722.34	0.59
37	600547	山东黄金	947,951	42,506,122.84	0.59
38	600104	上海汽车	2,232,090	41,829,366.60	0.58
39	000338	潍柴动力	913,782	41,513,116.26	0.57
40	600028	中国石化	5,028,207	41,382,143.61	0.57
41	600089	特变电工	3,182,543	41,182,106.42	0.57
42	002304	洋河股份	325,960	41,123,113.60	0.57
43	600999	招商证券	2,164,673	39,786,689.74	0.55
44	600019	宝钢股份	6,343,958	38,254,066.74	0.53
45	601600	中国铝业	3,470,687	38,212,263.87	0.53
46	000568	泸州老窖	841,805	37,982,241.60	0.52
47	601699	潞安环能	1,111,421	36,465,723.01	0.50
48	600015	华夏银行	3,308,515	35,963,558.05	0.50
49	600362	江西铜业	1,002,302	35,521,582.88	0.49
50	600348	国阳新能	1,452,075	35,053,090.50	0.48
51	600383	金地集团	5,399,498	34,610,782.18	0.48
52	601168	西部矿业	2,302,051	34,116,395.82	0.47
53	601628	中国人寿	1,811,246	33,960,862.50	0.47
54	601766	中国南车	4,741,325	33,758,234.00	0.46
55	600256	广汇股份	1,410,510	33,541,927.80	0.46
56	600887	伊利股份	1,930,371	32,140,677.15	0.44
57	600739	辽宁成大	1,098,178	30,529,348.40	0.42
58	600489	中金黄金	1,116,947	30,481,483.63	0.42
59	600068	葛洲坝	2,526,671	30,294,785.29	0.42
60	600406	国电南瑞	760,986	27,623,791.80	0.38

61	600795	国电电力	9,294,859	27,512,782.64	0.38
62	600690	青岛海尔	970,805	27,133,999.75	0.37
63	601299	中国北车	4,009,067	26,860,748.90	0.37
64	000069	华侨城 A	3,377,136	26,713,145.76	0.37
65	601988	中国银行	8,418,569	26,434,306.66	0.36
66	000012	南 玻 A	1,586,060	26,169,990.00	0.36
67	000423	东阿阿胶	631,746	26,065,839.96	0.36
68	600010	包钢股份	3,102,652	25,907,144.20	0.36
69	600188	兖州煤业	714,856	25,234,416.80	0.35
70	601688	华泰证券	2,028,612	25,053,358.20	0.34
71	601390	中国中铁	6,191,969	24,705,956.31	0.34
72	000425	徐工机械	996,313	24,698,599.27	0.34
73	600518	康美药业	1,858,520	24,458,123.20	0.34
74	600309	烟台万华	1,305,516	24,426,204.36	0.34
75	000895	双汇发展	365,798	24,168,273.86	0.33
76	002202	金风科技	1,589,943	23,737,848.99	0.33
77	600150	中国船舶	319,983	23,675,542.17	0.33
78	000060	中金岭南	1,743,699	23,191,196.70	0.32
79	601618	中国中冶	5,882,796	23,178,216.24	0.32
80	601919	中国远洋	2,766,125	22,931,176.25	0.32
81	000039	中集集团	1,041,221	22,781,915.48	0.31
82	000009	中国宝安	1,317,098	22,680,427.56	0.31
83	000709	河北钢铁	4,982,412	22,520,502.24	0.31
84	601009	南京银行	2,509,560	22,510,753.20	0.31
85	601958	金钼股份	1,168,857	22,500,497.25	0.31
86	601186	中国铁建	3,717,274	22,489,507.70	0.31
87	601898	中煤能源	2,210,238	22,102,380.00	0.30
88	000402	金 融 街	2,924,271	21,844,304.37	0.30
89	000937	冀中能源	837,812	21,238,534.20	0.29
90	000630	铜陵有色	858,328	20,685,704.80	0.28
91	600875	东方电气	803,604	20,491,902.00	0.28
92	000623	吉林敖东	664,620	20,476,942.20	0.28
93	600276	恒瑞医药	678,714	20,341,058.58	0.28
94	600005	武钢股份	4,875,412	20,232,959.80	0.28
95	600415	小商品城	1,643,142	20,194,215.18	0.28
96	600132	重庆啤酒	350,634	20,126,391.60	0.28
97	000725	京东方 A	7,355,645	20,080,910.85	0.28
98	601666	平煤股份	1,425,550	19,971,955.50	0.27
99	600029	南方航空	2,544,056	19,945,399.04	0.27

100	601111	中国国航	2,011,527	19,290,543.93	0.27
101	000538	云南白药	335,314	19,139,723.12	0.26
102	600881	亚泰集团	2,287,932	19,058,473.56	0.26
103	000933	神火股份	1,217,159	18,512,988.39	0.25
104	000783	长江证券	1,718,020	18,503,075.40	0.25
105	002073	软控股份	896,400	18,465,840.00	0.25
106	000528	柳 工	811,639	18,367,390.57	0.25
107	000100	TCL 集团	6,141,199	18,362,185.01	0.25
108	000401	冀东水泥	732,223	18,298,252.77	0.25
109	600058	五矿发展	517,718	17,747,373.04	0.24
110	000825	太钢不锈	3,439,200	17,711,880.00	0.24
111	600660	福耀玻璃	1,693,065	17,540,153.40	0.24
112	600497	驰宏锌锗	790,994	17,441,417.70	0.24
113	600642	申能股份	3,426,103	17,370,342.21	0.24
114	600123	兰花科创	413,770	17,287,310.60	0.24
115	600271	航天信息	668,996	17,286,856.64	0.24
116	600143	金发科技	1,011,729	16,653,059.34	0.23
117	000878	云南铜业	758,673	16,622,525.43	0.23
118	000768	西飞国际	1,495,837	16,469,165.37	0.23
119	601727	上海电气	2,378,953	16,462,354.76	0.23
120	000758	中色股份	462,867	16,362,348.45	0.23
121	600100	同方股份	1,555,960	16,275,341.60	0.22
122	601607	上海医药	967,519	16,254,319.20	0.22
123	000960	锡业股份	547,325	15,927,157.50	0.22
124	600177	雅戈尔	1,613,211	15,922,392.57	0.22
125	601117	中国化学	1,787,052	15,833,280.72	0.22
126	600009	上海机场	1,220,264	15,619,379.20	0.22
127	601106	中国一重	3,157,958	15,316,096.30	0.21
128	000024	招商地产	831,906	15,223,879.80	0.21
129	002142	宁波银行	1,392,870	15,154,425.60	0.21
130	600655	豫园商城	1,388,437	15,106,194.56	0.21
131	600583	海油工程	2,348,260	15,075,829.20	0.21
132	600550	天威保变	828,924	14,928,921.24	0.21
133	600832	东方明珠	1,923,787	14,909,349.25	0.21
134	600115	东方航空	2,819,179	14,659,730.80	0.20
135	600153	建发股份	1,621,269	14,429,294.10	0.20
136	600600	青岛啤酒	420,134	14,343,374.76	0.20
137	600320	振华重工	2,132,685	14,182,355.25	0.20
138	600664	哈药股份	899,801	14,126,875.70	0.19

139	601333	广深铁路	3,412,604	14,025,802.44	0.19
140	601998	中信银行	2,937,827	13,954,678.25	0.19
141	000800	一汽轿车	982,630	13,914,040.80	0.19
142	600741	华域汽车	1,247,646	13,886,299.98	0.19
143	601101	昊华能源	219,260	13,837,498.60	0.19
144	601001	大同煤业	808,388	13,742,596.00	0.19
145	000422	湖北宜化	654,943	13,707,956.99	0.19
146	600549	厦门钨业	329,361	13,645,426.23	0.19
147	600694	大商股份	354,679	13,559,378.17	0.19
148	600166	福田汽车	1,528,481	13,267,215.08	0.18
149	600395	盘江股份	399,678	13,265,312.82	0.18
150	600219	南山铝业	1,401,341	13,186,618.81	0.18
151	002106	莱宝高科	435,000	13,158,750.00	0.18
152	002155	辰州矿业	396,570	12,963,873.30	0.18
153	002001	新 和 成	438,274	12,907,169.30	0.18
154	000680	山推股份	733,356	12,899,732.04	0.18
155	601179	中国西电	2,104,462	12,837,218.20	0.18
156	600535	天士力	311,710	12,820,632.30	0.18
157	601808	中海油服	714,939	12,768,810.54	0.18
158	600804	鹏博士	1,616,264	12,752,322.96	0.18
159	600196	复星医药	1,149,788	12,509,693.44	0.17
160	000869	张 裕 A	126,345	12,482,886.00	0.17
161	000729	燕京啤酒	730,705	12,400,063.85	0.17
162	000969	安泰科技	622,248	12,152,503.44	0.17
163	000778	新兴铸管	1,151,421	12,147,491.55	0.17
164	600970	中材国际	440,029	12,025,992.57	0.17
165	600598	北大荒	858,652	12,021,128.00	0.17
166	600418	江淮汽车	1,078,180	11,978,579.80	0.16
167	600859	王府井	299,394	11,966,778.18	0.16
168	600376	首开股份	902,382	11,920,466.22	0.16
169	600997	开滦股份	745,431	11,897,078.76	0.16
170	600352	浙江龙盛	1,241,134	11,890,063.72	0.16
171	600169	太原重工	1,170,793	11,883,548.95	0.16
172	600631	百联股份	797,636	11,868,823.68	0.16
173	002007	华兰生物	347,881	11,807,081.14	0.16
174	000562	宏源证券	705,736	11,792,848.56	0.16
175	600267	海正药业	314,922	11,759,187.48	0.16
176	600125	铁龙物流	1,103,512	11,631,016.48	0.16
177	600811	东方集团	1,688,745	11,618,565.60	0.16

178	000839	中信国安	1,116,089	11,618,486.49	0.16
179	601118	海南橡胶	942,963	11,617,304.16	0.16
180	600331	宏达股份	872,310	11,610,446.10	0.16
181	600208	新湖中宝	1,859,642	11,585,569.66	0.16
182	000625	长安汽车	1,261,486	11,542,596.90	0.16
183	600812	华北制药	993,600	11,446,272.00	0.16
184	600703	三安光电	697,479	11,438,655.60	0.16
185	600635	大众公用	1,936,638	11,426,164.20	0.16
186	600893	航空动力	657,850	11,374,226.50	0.16
187	000652	泰达股份	1,467,393	11,269,578.24	0.16
188	600649	城投控股	1,387,501	11,266,508.12	0.16
189	600085	同仁堂	314,457	11,213,536.62	0.15
190	600316	洪都航空	346,312	11,161,635.76	0.15
191	600809	山西汾酒	156,797	10,983,629.85	0.15
192	600582	天地科技	488,567	10,816,873.38	0.15
193	000728	国元证券	948,607	10,719,259.10	0.15
194	600216	浙江医药	341,106	10,707,317.34	0.15
195	000876	新希望	531,131	10,596,063.45	0.15
196	601866	中海集运	2,873,469	10,459,427.16	0.14
197	002128	露天煤业	480,569	10,452,375.75	0.14
198	000061	农产品	649,584	10,367,360.64	0.14
199	000898	鞍钢股份	1,512,544	10,285,299.20	0.14
200	600062	双鹤药业	414,188	10,267,720.52	0.14
201	002422	科伦药业	173,811	10,254,849.00	0.14
202	600221	海南航空	1,427,600	10,193,064.00	0.14
203	600108	亚盛集团	1,677,905	10,184,883.35	0.14
204	600588	用友软件	492,639	10,177,921.74	0.14
205	600066	宇通客车	439,453	10,168,942.42	0.14
206	600516	方大炭素	772,188	10,138,828.44	0.14
207	600718	东软集团	889,287	10,120,086.06	0.14
208	600839	四川长虹	3,008,460	10,048,256.40	0.14
209	600808	马钢股份	2,882,505	10,031,117.40	0.14
210	600018	上港集团	2,570,336	10,024,310.40	0.14
211	000059	辽通化工	724,829	9,843,177.82	0.14
212	601018	宁波港	3,057,800	9,784,960.00	0.13
213	601158	重庆水务	1,159,195	9,574,950.70	0.13
214	600118	中国卫星	425,669	9,539,242.29	0.13
215	600879	航天电子	783,449	9,526,739.84	0.13
216	600779	水井坊	412,918	9,257,621.56	0.13

217	600895	张江高科	980,546	9,256,354.24	0.13
218	000807	云铝股份	857,764	9,229,540.64	0.13
219	600595	中孚实业	914,643	9,183,015.72	0.13
220	002122	天马股份	717,229	9,180,531.20	0.13
221	601377	兴业证券	531,300	9,154,299.00	0.13
222	002092	中泰化学	696,881	9,143,078.72	0.13
223	600239	云南城投	696,025	8,950,881.50	0.12
224	600432	吉恩镍业	391,693	8,726,920.04	0.12
225	600500	中化国际	867,960	8,670,920.40	0.12
226	600508	上海能源	349,002	8,505,178.74	0.12
227	000999	华润三九	472,820	8,487,119.00	0.12
228	600546	山煤国际	271,674	8,473,512.06	0.12
229	600170	上海建工	532,056	8,294,753.04	0.11
230	600717	天津港	1,011,085	8,270,675.30	0.11
231	002493	荣盛石化	265,770	8,209,635.30	0.11
232	601918	国投新集	670,303	8,150,884.48	0.11
233	600675	中华企业	1,195,565	8,129,842.00	0.11
234	000959	首钢股份	1,836,456	8,117,135.52	0.11
235	600266	北京城建	536,866	8,079,833.30	0.11
236	600312	平高电气	791,121	8,029,878.15	0.11
237	600369	西南证券	672,231	7,979,381.97	0.11
238	000968	煤气化	310,120	7,855,339.60	0.11
239	600037	歌华有线	768,203	7,827,988.57	0.11
240	000780	平庄能源	489,889	7,789,235.10	0.11
241	000559	万向钱潮	961,897	7,733,651.88	0.11
242	600528	中铁二局	881,029	7,656,142.01	0.11
243	600220	江苏阳光	1,507,348	7,597,033.92	0.10
244	601888	中国国旅	318,733	7,531,660.79	0.10
245	600008	首创股份	1,328,287	7,518,104.42	0.10
246	600456	宝钛股份	259,687	7,494,566.82	0.10
247	002399	海普瑞	193,248	7,480,630.08	0.10
248	600428	中远航运	1,020,647	7,369,071.34	0.10
249	000690	宝新能源	1,459,432	7,326,348.64	0.10
250	000612	焦作万方	405,885	7,240,988.40	0.10
251	000027	深圳能源	957,416	7,218,916.64	0.10
252	600481	双良节能	489,094	7,072,299.24	0.10
253	600151	航天机电	578,045	6,664,858.85	0.09
254	600096	云天化	334,953	6,662,215.17	0.09
255	600269	赣粤高速	1,409,969	6,640,953.99	0.09

256	002146	荣盛发展	675,086	6,615,842.80	0.09
257	000021	长城开发	796,527	6,595,243.56	0.09
258	000718	苏宁环球	822,374	6,578,992.00	0.09
259	000951	中国重汽	354,457	6,550,365.36	0.09
260	002310	东方园林	72,650	6,538,500.00	0.09
261	600674	川投能源	450,616	6,461,833.44	0.09
262	600026	中海发展	763,765	6,446,176.60	0.09
263	601718	际华集团	1,397,232	6,427,267.20	0.09
264	600971	恒源煤电	157,690	6,364,368.40	0.09
265	600863	内蒙华电	717,720	6,358,999.20	0.09
266	000031	中粮地产	1,095,003	6,263,417.16	0.09
267	002069	獐子岛	257,575	6,259,072.50	0.09
268	600737	中粮屯河	607,068	6,222,447.00	0.09
269	000686	东北证券	308,727	6,205,412.70	0.09
270	600823	世茂股份	424,000	6,203,120.00	0.09
271	601098	中南传媒	648,803	6,183,092.59	0.09
272	601717	郑煤机	169,057	6,163,818.22	0.08
273	600183	生益科技	660,906	6,067,117.08	0.08
274	002244	滨江集团	489,767	6,024,134.10	0.08
275	601558	华锐风电	203,044	5,934,976.12	0.08
276	600380	健康元	636,305	5,860,369.05	0.08
277	600307	酒钢宏兴	988,089	5,414,727.72	0.07
278	600517	置信电气	448,227	5,410,099.89	0.07
279	002500	山西证券	579,540	5,302,791.00	0.07
280	600161	天坛生物	311,211	5,275,026.45	0.07
281	600109	国金证券	362,313	5,271,654.15	0.07
282	600300	维维股份	1,009,433	5,198,579.95	0.07
283	002415	海康威视	120,668	4,741,045.72	0.07
284	000961	中南建设	423,057	4,459,020.78	0.06
285	601268	二重重装	408,145	4,424,291.80	0.06
286	002294	信立泰	131,492	4,416,816.28	0.06
287	601107	四川成渝	783,442	4,402,944.04	0.06
288	601933	永辉超市	182,000	4,402,580.00	0.06
289	600004	白云机场	555,394	4,382,058.66	0.06
290	002028	思源电气	318,500	4,360,265.00	0.06
291	601369	陕鼓动力	395,693	4,340,752.21	0.06
292	600998	九州通	337,830	4,172,200.50	0.06
293	000927	一汽夏利	577,807	4,079,317.42	0.06
294	000536	华映科技	169,103	3,926,571.66	0.05

295	002405	四维图新	115,968	3,612,403.20	0.05
296	000685	中山公用	216,937	3,609,831.68	0.05
297	002498	汉缆股份	168,285	3,252,949.05	0.04
298	002385	大北农	96,732	3,134,116.80	0.04
299	601519	大智慧	167,800	2,624,392.00	0.04

注：上述股票中包含沪深 300 指数备选成份股。

#### 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 名的股票投资明细

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	000776	广发证券	75,078,168.33	0.88
2	601939	建设银行	64,863,213.51	0.76
3	600887	伊利股份	48,988,637.14	0.57
4	600837	海通证券	46,120,429.32	0.54
5	600406	国电南瑞	34,831,386.09	0.41
6	600276	恒瑞医药	34,270,459.75	0.40
7	600000	浦发银行	32,426,234.81	0.38
8	002304	洋河股份	27,785,723.26	0.33
9	601006	大秦铁路	27,564,692.17	0.32
10	601106	中国一重	25,247,012.99	0.30
11	600999	招商证券	24,843,683.84	0.29
12	600115	东方航空	24,706,372.98	0.29
13	600036	招商银行	23,525,840.57	0.28
14	601688	华泰证券	21,028,840.33	0.25
15	601318	中国平安	20,377,734.22	0.24
16	600703	三安光电	19,863,127.70	0.23
17	002073	软控股份	19,404,432.99	0.23
18	601989	中国重工	19,110,132.51	0.22
19	000157	中联重科	17,822,737.80	0.21
20	002422	科伦药业	17,710,381.74	0.21

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 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	77,524,798.16	0.91
2	600036	招商银行	71,668,164.89	0.84

3	600016	民生银行	63,491,159.42	0.74
4	601328	交通银行	60,233,808.80	0.71
5	601166	兴业银行	57,953,726.21	0.68
6	600030	中信证券	48,524,709.25	0.57
7	601088	中国神华	46,321,087.49	0.54
8	600000	浦发银行	45,648,473.50	0.53
9	000002	万科A	41,644,969.25	0.49
10	600900	长江电力	39,058,220.94	0.46
11	601601	中国太保	36,507,921.81	0.43
12	601398	工商银行	35,334,360.70	0.41
13	600519	贵州茅台	35,211,504.05	0.41
14	601939	建设银行	33,245,323.95	0.39
15	000858	五粮液	30,162,352.58	0.35
16	000063	中兴通讯	28,994,744.72	0.34
17	600031	三一重工	27,462,274.58	0.32
18	002024	苏宁电器	26,573,044.54	0.31
19	601169	北京银行	25,615,786.99	0.30
20	600011	华能国际	24,008,582.62	0.28

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。

#### 7.4.3 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	1,794,665,770.05
卖出股票收入（成交）总额	2,896,660,289.61

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。

#### 7.5 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投资组合。

#### 7.6 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投资组合。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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投资。

#### 7.8 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投资。

#### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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的股票。

**7.9.3 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	1,030,975.91
2	应收证券清算款	54,742,681.50
3	应收股利	8,887,846.69
4	应收利息	70,615.25
5	应收申购款	961,297.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,693,417.10

**7.9.4 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。

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

**7.9.6 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。

**§ 8 基金份额持有人信息**
**8.1 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
382,630	20,574.01	1,617,487,847.33	20.55%	6,254,744,881.41	79.45%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况**

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开放式基金	357,243.25	0.005%

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日 ( 2006 年 4 月 6 日 ) 基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额	9,038,687,823.51
本报告期基金总申购份额	1,322,247,389.60
减:本报告期基金总赎回份额	2,488,702,484.37

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,872,232,728.74

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

2011 年 1 月 21 日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可【2011】116 号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 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安永华明会计师事务所，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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中金公司	2	1,077,552,542.12	23.04%	913,358.11	23.24%	-
南京证券	1	774,138,561.42	16.55%	658,014.13	16.75%	-
中信证券	1	714,252,338.17	15.27%	607,113.68	15.45%	-
北京高华	1	390,486,666.48	8.35%	331,910.60	8.45%	-
光大证券	2	361,511,804.55	7.73%	295,528.48	7.52%	-
联合证券	2	304,932,294.44	6.52%	247,758.93	6.31%	-
招商证券	3	223,469,994.79	4.78%	181,570.28	4.62%	-
长城证券	2	213,014,825.79	4.55%	181,061.36	4.61%	-
华创证券	1	168,713,830.89	3.61%	137,081.26	3.49%	-

广发证券	1	152,060,654.23	3.25%	129,249.19	3.29%	-
宏源证券	1	102,068,695.11	2.18%	82,931.84	2.11%	-
申银万国	1	93,863,936.68	2.01%	79,784.41	2.03%	-
兴业证券	2	59,054,938.13	1.26%	49,586.94	1.26%	-
西部证券	1	42,245,986.94	0.90%	34,325.12	0.87%	-
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-

注：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。

本基金本报告期内租用席位变更情况。

本报告期内增加席位：南京证券、银河证券、国金证券、红塔证券、广发证券、世纪证券、上海证券、齐鲁证券、英大证券、北京高华、国信证券、安信证券、中信证券、东北证券、长城证券、中银国际、光大证券、瑞银证券、宏源证券。本报告期内退租席位：中银国际、国金证券。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
南京证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	2,816,186.20	11.01%	-	0.00%	-	0.00%
北京高华	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	1,246,424.50	4.87%	-	0.00%	-	0.00%
联合证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	21,514,032.20	84.12%	-	0.00%	-	0.00%
宏源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申银万国	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东北证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
安信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
齐鲁证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
上海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于赎回公司持有旗下开放式基金的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 1 月 15 日
2	关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 1 月 19 日
3	关于赎回公司持有旗下开放式基金的公告的更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 1 月 19 日
4	关于开通网上直销赎回转认/申购功能的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 3 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“上海汽车”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 10 日
6	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 15 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金所持双汇发展（000895）估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 21 日
8	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 31 日
9	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金网上银行申购费率优惠活动的补充公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 1 日
10	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金网上银行申购费率优惠活动的补充公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 6 日
11	关于旗下部分基金增加上海农村商业银行为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 16 日
12	关于开通汇付天天盈账户第三方支付业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 19 日
13	关于恢复旗下基金所持有的“双汇发展”市价估值方法的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 21 日
14	关于增加天风证券有限责任公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 13 日
15	关于旗下部分基金增加天源证券经纪有限公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 20 日
16	关于增加国盛证券有限责任公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 25 日

17	大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 6 月 15 日
18	大成基金管理有限公司关于广州分公司迁址的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 6 月 22 日
19	关于大成沪深 300 指数证券投资基金在安信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 6 月 30 日

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- (一) 《关于同意大成沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》;
- (二) 《关于大成沪深 300 指数证券投资基金备案确认的函》;
- (三) 《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》;
- (四) 《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》;
- (五) 大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
- (六) 本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

#### 12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

#### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 400-888-5558 (免长途通话费用)。

国际互联网址: <http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十七日