

大成核心双动力股票型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 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

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
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.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§ 4 管理人报告	6
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.....	8
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
§ 5 托管人报告	9
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.....	9
§ 6 半年度财务报表(未经审计)	10
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
§ 7 投资组合报告	21
7.1 期末基金资产组合情况.....	21
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	21
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.....	22
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	23
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	25
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.....	25
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.....	25
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.....	25
7.9 投资组合报告附注.....	25
§ 8 基金份额持有人信息	26
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	26
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.....	26
§ 9 开放式基金份额变动	26

§ 10 重大事件揭示	26
10.1 基金份额持有人大会决议.....	26
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.....	26
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	26
10.4 基金投资策略的改变.....	26
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	27
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.....	27
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	27
10.8 其他重大事件.....	27
§ 11 备查文件目录	28
11.1 备查文件目录.....	28
11.2 存放地点.....	28
11.3 查阅方式.....	28

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成核心双动力股票型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力股票
基金主代码	090011
交易代码	090011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 22 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	902,915,221.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以稳健的投资策略为主，采用合理的方法适当提升风险收益水平，力争获取超越业绩比较基准的中长期投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下的方式实施大类资产间的战略配置，并采用“核心-双卫星”策略管理股票资产。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是主动投资的股票基金，预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	蒋松云
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张树忠	姜建清

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 55 号中国工商银行托管业务部
-------------	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 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	-69,032,298.42
本期利润	-96,856,220.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0968
本期加权平均净值利润率	-9.37%
本期基金份额净值增长率	-9.91%
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	-8,186,911.12
期末可供分配基金份额利润	-0.0091
期末基金资产净值	894,728,310.31
期末基金份额净值	0.991
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	-0.90%

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。

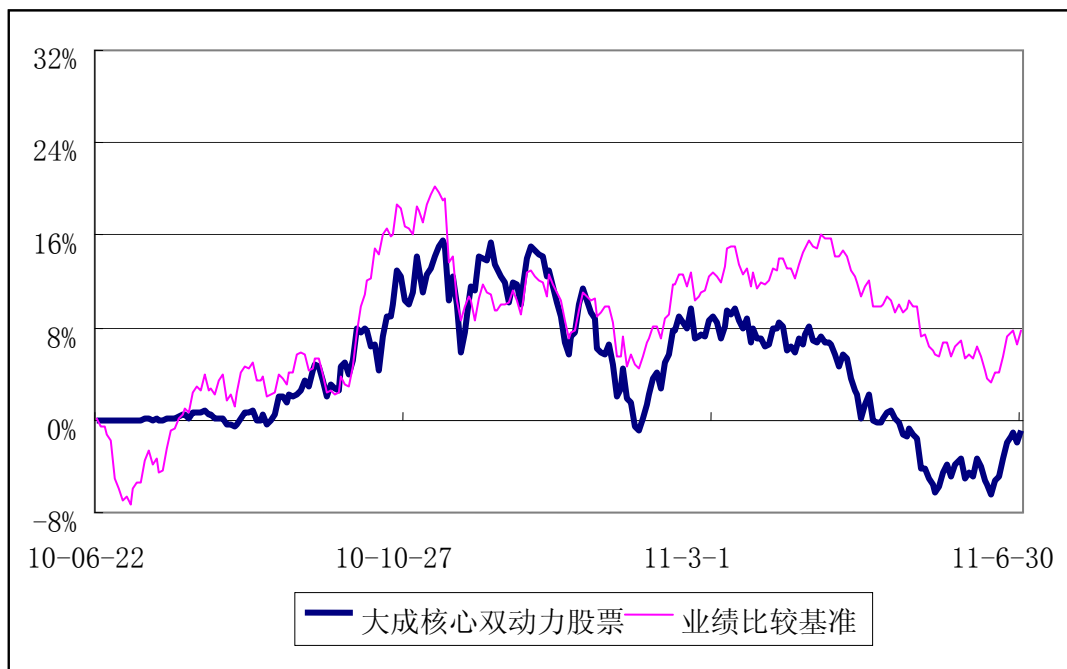
3.2 基金净值表现

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	3.77%	1.01%	1.01%	0.90%	2.76%	0.11%
过去三个月	-6.33%	0.98%	-3.94%	0.83%	-2.39%	0.15%
过去六个月	-9.91%	1.08%	-1.52%	0.93%	-8.39%	0.15%
过去一年	-0.90%	1.13%	14.50%	1.06%	-15.40%	0.07%

自基金合同 生效起至今	-0.90%	1.11%	7.77%	1.07%	-8.67%	0.04%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，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 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华先生	本基金基金经理、股票投资部总监。	2010年6月22日	-	11年	工商管理硕士，经济学博士研究生。曾任光大证券研究所研究员、四川启明星投资公司总经理助理。2004年4月加入大成基金管理有限公司，2006年1月-2008年1月期间曾任大成价值增长证券投资基金基金经理。2005年2月起开始担任景阳证券投资基金（2007年12月11日封转开为大成景阳领先股票型证券投资基金）基金经理。2010年6月22日起兼任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。现同时担任大成基金管理有限公司股票投资部总监。具有基金从业资格。国籍：中国。
徐雄晖先生	本基金基金经理助理	2010年6月22日	--	3年	经济学硕士，2008年加入大成基金管理有限公司，主要负责商业、服装、旅游行业研究，2010年2月25日起担任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理助理，并于2010年6月22日起兼任本基金基金经理助理。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合规守信情况的说明

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》、《大成核心双动力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，大成核心双动力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

进入本轮经济复苏的第三年，通胀已然成为国内中短期经济增长的核心问题。为应对持续加大的通胀压力，今年以来央行多次加息，存款准备金率也提至历史新高。但国际大宗商品价格与国内农产品生产周期的波动加大了货币政策调控的难度，二季度，通货膨胀创出两年新高，同时经济增速反而大幅下滑。受资金成本上升和经济增速下滑的影响，市场估值出现了系统性下降。上半年沪深 300 指数下跌 2.69%，绝对估值较低的家电、钢铁、地产板块受此影响较小，上半年仍有上涨，而高估值的医药、TMT 新兴产业跌幅较大。

出于对调控政策的担忧，上半年我们适当降低了仓位，减持了部分估值较高的消费、医药和新兴产业类个股，提高了低估值个股在组合中的配置比重。但由于调仓的时机略显滞后，加上冲击成本的影响，上半年本基金没能跑赢大盘。

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 0.991 元，本报告期份额净值增长率为-9.91%，同期业绩比较基准增长率为-1.52%，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

对于后续经济的增长，我们不过度乐观也过度悲观。目前国内政策已进入一个观察期，后续的紧缩政策对通胀边际上的抑制作用在减小，而对经济边际上的伤害在加大，如果没有明确的恶性通胀信号出现，紧缩政策应该已经告一段落，这对缓解 2 季度以来经济增速的下滑有一定正面作用。但另一方面，在 2008 年采取了一系列积极的财政政策与货币扩张后，一些后遗症如汽车等商品消费的提前透支、地方融资平台等问题已经限制了后续政策放松的空间。海外希腊等国主权债务危机与美国经济复苏的进展仍有不确定性，这可能给我国出口带来一定风险。

对于后续市场，我们认为二级市场的供需结构已经发生很大改变，这种改变将对未来市场的投资产生相当大的影响。一方面是整体货币收紧带来资金的紧张，二级市场资金紧缺仍会持续相当长的时间；另一方面，新股发行带来了二级市场股票供给的快速增加。这种新的供需结构下，个股的真正内在价值将变得异常重要，而主题投资、题材炒作能获得的收益将大大降低。未来我们将更加注重个股的研究，重点关注上市公司治理结构、行业发展空间、竞争优势等基本面状况，

并适当采取组合投资的办法降低个股投资的风险，为持有人创造更好的回报。

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

2011 年上半年，本基金托管人在对大成核心双动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2011 年上半年，大成核心双动力股票型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力股票型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务报表(未经审计)
6.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.2.1	107,516,866.94	102,443,129.64
结算备付金		2,252,513.88	6,617,806.43
存出保证金		1,388,031.75	909,722.54
交易性金融资产	6.4.2.2	760,757,419.39	1,024,406,742.20
其中：股票投资		760,757,419.39	1,024,406,742.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		25,195,535.16	8,626,286.34
应收利息	6.4.2.5	20,647.36	25,117.44
应收股利		251,913.48	-
应收申购款		163,535.47	1,179,245.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		897,546,463.43	1,144,208,049.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	13,199,041.45
应付赎回款		172,256.90	115,303.05
应付管理人报酬		1,070,370.49	1,487,976.26
应付托管费		178,395.11	247,996.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	948,318.78	1,948,218.84
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	448,811.84	310,434.54
负债合计		2,818,153.12	17,308,970.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	902,915,221.43	1,024,888,900.33
未分配利润	6.4.2.10	-8,186,911.12	102,010,179.32
所有者权益合计		894,728,310.31	1,126,899,079.65
负债和所有者权益总计		897,546,463.43	1,144,208,049.83

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.991 元，基金份额总额 902,915,221.43 份。

6.2 利润表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

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 6 月 22 日(基 金合同生效日) 至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-83,143,298.24	259,911.57
1. 利息收入		623,179.98	259,911.57
其中：存款利息收入	6.4.2.11	623,179.98	187,722.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	72,189.57
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-56,685,125.91	-
其中：股票投资收益	6.4.2.12	-61,446,934.94	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.2.14	-	-
股利收益	6.4.2.15	4,761,809.03	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.16	-27,823,921.71	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	742,569.40	-
减：二、费用		13,712,921.89	454,869.87
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	7,726,028.56	385,691.58
2. 托管费	6.4.5.2.2	1,287,671.45	64,281.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.18	4,486,940.31	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.2.19	212,281.57	4,896.36

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-96,856,220.13	-194,958.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-96,856,220.13	-194,958.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

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）	1,024,888,900.33	102,010,179.32	1,126,899,079.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-96,856,220.13	-96,856,220.13
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）	-121,973,678.90	-13,340,870.31	-135,314,549.21
其中：1. 基金申购款	435,823,006.60	23,564,002.15	459,387,008.75
2. 基金赎回款	-557,796,685.50	-36,904,872.46	-594,701,557.96
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）	902,915,221.43	-8,186,911.12	894,728,310.31
项目	上年度可比期间 2010 年 6 月 22 日（基金合同生效日）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）	1,173,262,454.69	-	1,173,262,454.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-194,958.30	-194,958.30
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	1,173,262,454.69	-194,958.30	1,173,067,496.39

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：

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

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	107,516,866.94
定期存款	-
其他存款	-
合计：	107,516,866.94

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	771,581,194.74	760,757,419.39	-10,823,775.35
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	771,581,194.74	760,757,419.39	-10,823,775.35

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

6.4.2.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.2.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	19,735.12
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	912.24
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	20,647.36

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	948,318.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	948,318.78

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	250,000.00
应付赎回费	457.56
预提费用	198,354.28
合计	448,811.84

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	1,024,888,900.33	1,024,888,900.33
本期申购	435,823,006.60	435,823,006.60
本期赎回(以“-”号填列)	-557,796,685.50	-557,796,685.50
本期末	902,915,221.43	902,915,221.43

注：本期申购包含基金转入的份额和金额；本期赎回包含基金转出的份额和金额。

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	70,232,497.39	31,777,681.93	102,010,179.32
本期利润	-69,032,298.42	-27,823,921.71	-96,856,220.13
本期基金份额交易产生的变动数	-8,707,193.83	-4,633,676.48	-13,340,870.31
其中：基金申购款	22,810,728.63	753,273.52	23,564,002.15
基金赎回款	-31,517,922.46	-5,386,950.00	-36,904,872.46

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,506,994.86	-679,916.26	-8,186,911.12

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	593,821.90
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	20,311.28
其他	9,046.80
合计	623,179.98

6.4.2.12 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	1,536,325,448.05
减：卖出股票成本总额	1,597,772,382.99
买卖股票差价收入	-61,446,934.94

6.4.2.13 债券投资收益

无。

6.4.2.14 衍生工具收益

无。

6.4.2.15 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	4,761,809.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,761,809.03

6.4.2.16 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	-27,823,921.71
——股票投资	-27,823,921.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-27,823,921.71

6.4.2.17 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	685,445.62
转换费收入	57,123.78
合计	742,569.40

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.2.18 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	4,486,940.31
银行间市场交易费用	-
合计	4,486,940.31

6.4.2.19 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	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	4,927.29
债券帐户维护费	9,000.00
合计	212,281.57

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

本基金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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、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
广东证券股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	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。

6.4.5 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

无。

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 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月22日（基金合同生 效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,726,028.56	385,691.58
其中：支付销售机构的客户维护费	696,553.59	70,822.17

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月22日（基金合同生 效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,287,671.45	64,281.93

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年6月22日(基金合同生效 日)至2010年6月30日
基金合同生效日（2010年6月22日）持有的基金份额	-	30,000,000.00
期初持有的基金份额	30,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	30,000,000.00	30,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.32%	2.56%

注：基金管理人认购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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年6月22日（基金合同生效日）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
中国工商银行	107,516,866.94	593,821.90	73,262,454.69	187,722.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

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

无。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

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、拒绝支付到期本息，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。本基金持有一家上市公司的股票，其公允价值不得超过基金资产净值的 10%，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发行的证券，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可通过银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市，因此均能及时变现。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可回购交易债券投资的公允价值。于资产负债表日，本基金所持有的金融负债的合约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	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	107,516,866.94	-	-	-	-	-	107,516,866.94
结算备付金	2,252,513.88	-	-	-	-	-	2,252,513.88
存出保证金	-	-	-	-	-	1,388,031.75	1,388,031.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	760,757,419.39	760,757,419.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,195,535.16	25,195,535.16
应收利息	-	-	-	-	-	20,647.36	20,647.36
应收股利	-	-	-	-	-	251,913.48	251,913.48
应收申购款	-	-	-	-	-	163,535.47	163,535.47
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	109,769,380.82	-	-	-	-	787,777,082.61	897,546,463.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	172,256.90	172,256.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,070,370.49	1,070,370.49
应付托管费	-	-	-	-	-	178,395.11	178,395.11

应付交易费用	-	-	-	-	-	948,318.78	948,318.78
其他负债	-	-	-	-	-	448,811.84	448,811.84
负债总计	-	-	-	-	-	2,818,153.12	2,818,153.12
利率敏感度缺口	109,769,380.82	-	-	-	-	784,958,929.49	894,728,310.31
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	102,443,129.64	-	-	-	-	-	102,443,129.64
结算备付金	6,617,806.43	-	-	-	-	-	6,617,806.43
存出保证金	-	-	-	-	-	909,722.54	909,722.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,024,406,742.20	1,024,406,742.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,626,286.34	8,626,286.34
应收利息	-	-	-	-	-	25,117.44	25,117.44
应收申购款	11,898.96	-	-	-	-	1,167,346.28	1,179,245.24
资产总计	109,072,835.03	-	-	-	-	1,035,135,214.80	1,144,208,049.83
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,199,041.45	13,199,041.45
应付赎回款	-	-	-	-	-	115,303.05	115,303.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,487,976.26	1,487,976.26
应付托管费	-	-	-	-	-	247,996.04	247,996.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,948,218.84	1,948,218.84
其他负债	-	-	-	-	-	310,434.54	310,434.54
负债总计	-	-	-	-	-	17,308,970.18	17,308,970.18
利率敏感度缺口	109,072,835.03	-	-	-	-	1,017,826,244.62	1,126,899,079.65

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2011 年 6 月 30 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末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，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

本基金的投资范围为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%。其中，资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的 0-20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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	公允价值	占基金资产

		净值比例(%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	760,757,419.39	85.03	1,024,406,742.20	90.90
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	760,757,419.39	85.03	1,024,406,742.20	90.90

6.4.8.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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:人民币万元)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 4,650	增加约 5,118
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 4,781	减少约 5,102

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	760,757,419.39	84.76
	其中:股票	760,757,419.39	84.76
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	109,769,380.82	12.23
6	其他资产	27,019,663.22	3.01
7	合计	897,546,463.43	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	67,909,611.00	7.59
C	制造业	511,601,484.86	57.18
C0	食品、饮料	173,026,683.07	19.34
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00

C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	97,126,999.31	10.86
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	87,765,639.12	9.81
C7	机械、设备、仪表	118,981,182.34	13.30
C8	医药、生物制品	34,700,981.02	3.88
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,990,821.18	0.89
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	12,330,798.70	1.38
G	信息技术业	45,440,576.85	5.08
H	批发和零售贸易	60,973,997.28	6.81
I	金融、保险业	39,210,000.00	4.38
J	房地产业	8,281,000.00	0.93
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	7,019,129.52	0.78
M	综合类	-	0.00
	合计	760,757,419.39	85.03

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	600585	海螺水泥	2,249,987	62,459,639.12	6.98
2	600519	贵州茅台	230,000	48,904,900.00	5.47
3	000792	盐湖股份	699,984	41,299,056.00	4.62
4	002024	苏宁电器	3,199,828	40,989,796.68	4.58
5	600132	重庆啤酒	700,000	40,180,000.00	4.49
6	000858	五粮液	999,971	35,718,964.12	3.99
7	600690	青岛海尔	1,199,978	33,539,385.10	3.75
8	600309	烟台万华	1,689,992	31,619,750.32	3.53
9	601088	中国神华	999,999	30,139,969.86	3.37
10	600887	伊利股份	1,699,871	28,302,852.15	3.16
11	600859	王府井	499,980	19,984,200.60	2.23
12	000629	攀钢钒钛	1,800,000	19,926,000.00	2.23
13	600298	安琪酵母	599,999	19,919,966.80	2.23
14	600000	浦发银行	2,000,000	19,680,000.00	2.20
15	601699	潞安环能	599,794	19,679,241.14	2.20
16	600036	招商银行	1,500,000	19,530,000.00	2.18

17	600050	中国联通	3,499,933	18,374,648.25	2.05
18	600276	恒瑞医药	599,966	17,980,981.02	2.01
19	000925	众合机电	1,000,000	17,280,000.00	1.93
20	000581	威孚高科	400,000	15,420,000.00	1.72
21	600382	广东明珠	1,499,958	15,179,574.96	1.70
22	600406	国电南瑞	399,922	14,517,168.60	1.62
23	600125	铁龙物流	1,169,905	12,330,798.70	1.38
24	000651	格力电器	500,000	11,750,000.00	1.31
25	000933	神火股份	640,000	9,734,400.00	1.09
26	300124	汇川技术	140,000	9,646,000.00	1.08
27	600889	南京化纤	899,955	8,828,558.55	0.99
28	600079	人福医药	400,000	8,824,000.00	0.99
29	002434	万里扬	299,979	8,477,406.54	0.95
30	600123	兰花科创	200,000	8,356,000.00	0.93
31	002146	荣盛发展	845,000	8,281,000.00	0.93
32	002230	科大讯飞	199,920	8,096,760.00	0.90
33	002039	黔源电力	399,941	7,990,821.18	0.89
34	600518	康美药业	600,000	7,896,000.00	0.88
35	600458	时代新材	399,981	7,695,634.44	0.86
36	000157	中联重科	499,923	7,688,815.74	0.86
37	000635	英力特	400,000	7,684,000.00	0.86
38	600880	博瑞传播	499,938	7,019,129.52	0.78
39	000807	云铝股份	500,000	5,380,000.00	0.60
40	600570	恒生电子	300,000	4,452,000.00	0.50

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 名的权益投资明细

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	000792	盐湖股份	59,604,985.45	5.29
2	600585	海螺水泥	54,752,375.99	4.86
3	601088	中国神华	46,760,046.17	4.15
4	600036	招商银行	43,213,066.97	3.83
5	600795	国电电力	36,053,133.36	3.20
6	600031	三一重工	35,614,789.44	3.16
7	000629	攀钢钒钛	34,484,063.78	3.06
8	000858	五粮液	32,867,410.11	2.92
9	000630	铜陵有色	32,094,321.95	2.85

10	600050	中国联通	30,660,437.09	2.72
11	601699	潞安环能	28,064,055.00	2.49
12	600000	浦发银行	26,853,902.39	2.38
13	002024	苏宁电器	26,700,638.96	2.37
14	600887	伊利股份	26,540,525.28	2.36
15	000925	众合机电	25,887,226.48	2.30
16	000581	威孚高科	25,755,627.20	2.29
17	600048	保利地产	25,590,796.29	2.27
18	000937	冀中能源	25,440,333.35	2.26
19	600111	包钢稀土	25,005,194.76	2.22
20	600376	首开股份	24,179,816.13	2.15
21	002146	荣盛发展	23,234,107.39	2.06
22	300124	汇川技术	22,976,224.13	2.04
23	600703	三安光电	22,831,578.24	2.03

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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 名的权益投资明细

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	59,602,047.82	5.29
2	000895	双汇发展	56,814,697.94	5.04
3	000937	冀中能源	47,498,391.21	4.21
4	601699	潞安环能	46,401,946.26	4.12
5	600887	伊利股份	44,436,693.74	3.94
6	600031	三一重工	39,917,651.75	3.54
7	600111	包钢稀土	38,617,599.00	3.43
8	600519	贵州茅台	35,689,487.30	3.17
9	600036	招商银行	35,123,002.53	3.12
10	600383	金地集团	34,832,669.71	3.09
11	000858	五粮液	34,565,016.59	3.07
12	000630	铜陵有色	33,372,994.05	2.96
13	000423	东阿阿胶	32,553,183.05	2.89
14	600795	国电电力	31,943,798.72	2.83
15	600048	保利地产	25,636,483.97	2.27
16	000848	承德露露	25,574,135.86	2.27
17	601111	中国国航	24,321,436.86	2.16
18	600376	首开股份	24,034,857.74	2.13

19	600703	三安光电	23,334,624.79	2.07
20	000792	盐湖股份	23,280,391.82	2.07
21	000925	众合机电	22,968,512.05	2.04

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	1,361,946,981.89
卖出股票收入（成交）总额	1,536,325,448.05

注：本项中“买入股票的成本（成交）总额”及“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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。

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。

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。

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。

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。

2011年5月27日，本基金投资的前十名证券之一五粮液因信息披露违法被中国证券监督管理委员会罚款60万元。本基金认为，该处罚不会对五粮液投资价值构成实质性负面影响。

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（元）
1	存出保证金	1,388,031.75
2	应收证券清算款	25,195,535.16
3	应收股利	251,913.48
4	应收利息	20,647.36
5	应收申购款	163,535.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,019,663.22

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未存在流通受限情况。

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
9,237	97,749.83	699,923,549.71	77.52%	202,991,671.72	22.48%

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	5,931,914.03	0.6570%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月22日）基金份额总额	1,173,262,454.69
本报告期期初基金份额总额	1,024,888,900.33
本报告期基金总申购份额	435,823,006.60
减：本报告期基金总赎回份额	557,796,685.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	902,915,221.43

§ 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

报告期内没有涉及本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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有限公司，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	
中信证券	1	1,654,081,227.07	57.07%	1,405,962.12	58.17%	
申银万国	1	1,244,120,762.87	42.93%	1,010,857.78	41.83%	
合计	2	2,898,201,989.94	100.00%	2,416,819.90	100.00%	

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。

本报告期内租用交易单元变更情况：无。

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	关于增加深圳农村商业银行股份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1月14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	关于旗下部分基金在中国邮政储蓄银行开通基金定期定额投资业务及参与定期定额投资优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011年1月28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	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

6	关于增加哈尔滨银行股份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 3 月 19 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
9	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
10	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
11	大成基金管理有限公司关于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 14 日
12	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
13	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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立《大成核心双动力股票型证券投资基金》的文件；
- 2、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

11.2 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。

11.3 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