

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
2011 年年度报告摘要
2011 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 28 日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成 2020 生命周期混合
基金主代码	090006
前端交易代码	090006
后端交易代码	091006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 13 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,779,556,841.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有良好流动性的权益证券、固定收益证券和（或）货币市场工具等，通过调整资产配置策略和精选证券，以超越业绩比较基准，寻求在一定风险承受水平下的当期收益和资本增值的整体最大化。在 2020 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2020 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。
投资策略	本基金在组合构建中强调风险收益比的合理优化，将纪律性和科学性结合起来，建立较全面的资产、个券投资价值评价体系，不断优化投资组合配置。本基金的投资策略分为两个层次：第一个层次是资产配置策略，即在权益类、固定收益证券和货币市场工具之间的配置比例；第二个层次是权益类证券和固定收益类证券等的投资。
业绩比较基准	基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日：75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数 2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日：45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日：25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数 2021 年 1 月 1 日以及该日以后：10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于生命周期型基金，2020 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日止，本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近股票基金；随着目标日期的临近，本基金逐步发展为一只低风险债券型基金。

注：大成基金管理有限公司根据《大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2011 年 1 月 1 日起，大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金使用的业绩比较基准由原“

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×新华富时中国 A600 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×新华富时中国 A600 指数+75%×中国债券总指数

2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×新华富时中国 A600 指数+90%×中国债券总指数
----------------------	--------------------------------

” 变更为 “

时间段	业绩比较基准
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	75%×新华富时中国 A600 指数+25%×中国债券总指数
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	45%×沪深 300 指数+55%×中国债券总指数
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25%×沪深 300 指数+75%×中国债券总指数
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	10%×沪深 300 指数+90%×中国债券总指数

”

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	唐州徽
	联系电话	0755-83183388	010-66594855
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	106,056,337.30	281,032,531.45	425,809,610.42
本期利润	-2,618,952,093.33	1,294,450,649.73	4,962,280,035.86
加权平均基金份额本期利润	-0.1950	0.0871	0.3003
本期基金份额净值增长率	-24.03%	12.57%	67.51%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3744	-0.3421	-0.3631
期末基金资产净值	7,994,743,236.01	11,661,521,606.37	11,321,763,407.78
期末基金份额净值	0.626	0.824	0.732

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

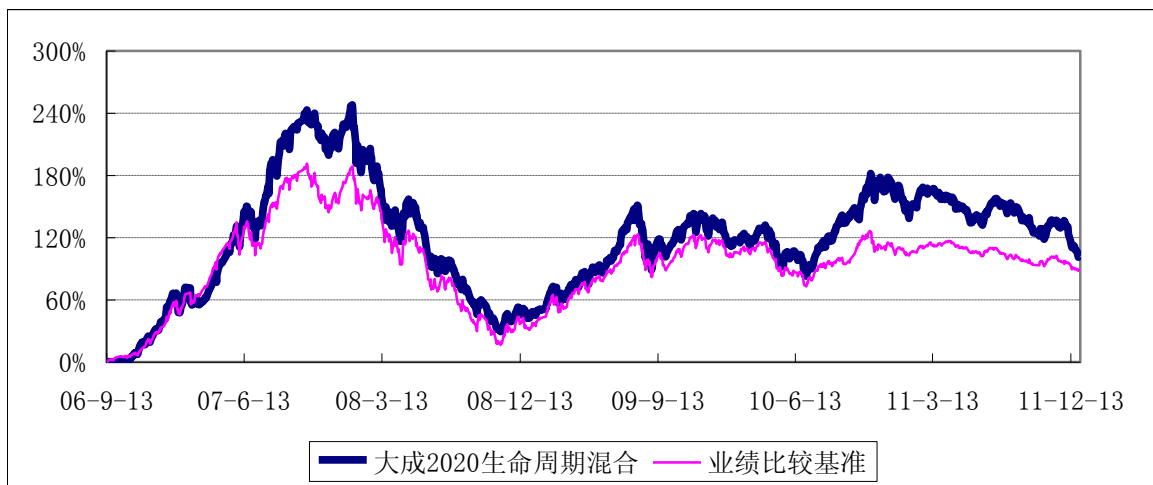
所列数字。

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
过去三个月	-9.14%	1.08%	-1.96%	0.63%	-7.18%	0.45%
过去六个月	-16.76%	0.99%	-8.54%	0.61%	-8.22%	0.38%
过去一年	-24.03%	1.02%	-8.95%	0.59%	-15.08%	0.43%
过去三年	43.25%	1.49%	45.07%	1.17%	-1.82%	0.32%
过去五年	47.12%	1.77%	42.19%	1.59%	4.93%	0.18%
自基金合同生效起至今	104.16%	1.74%	88.73%	1.56%	15.43%	0.18%

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的比较

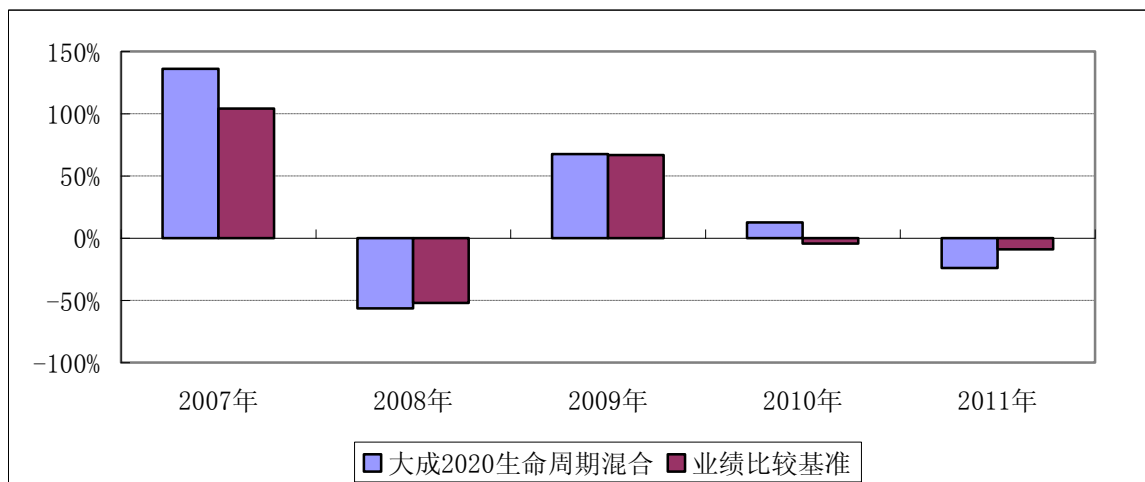


注：1. 自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2. 按基金合同规定，本基金各个时间段的资产配置比例如下：

时间段	权益类证券比例范围	固定收益证券及货币市场工具比例范围
基金合同生效日至 2010 年 12 月 31 日	0—95%	5—100%
2011 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	0—75%	25—100%
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	0—50%	50—100%
2021 年 1 月 1 日以及该日以后	0—20%	80—100%

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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12月31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19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、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金。

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	2010年2月12日	-	12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

	部总监			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等，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。2006 年 1 月至 2007 年 6 月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理；2007 年 10 月至 2008 年 11 月曾任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理。2008 年 12 月加入大成基金管理有限公司担任研究部总监。2009 年 3 月至 2010 年 8 月曾任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理；2010 年 2 月 12 日起担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理，现同时兼任大成国际资产管理有限公司董事。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》、《大成财富管理 2020 生命周期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，大成财富管理 2020 生命周期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

2011 年，中国 A 股市场大幅下跌，是一个较为典型的熊市。回头来看，原因在于：通货膨胀压力大幅超出预期，导致信贷及货币紧缩；房地产市场严厉的行政调控措施频繁出台；欧洲债务危机日益严重；中国经济缓慢减速及热钱持续流出。股市上半年的亮点在于机械、水泥等部分周期品种表现优异，下半年亮点在于食品饮料、纺织服装等消费类股票，全年看，低估值的银行和地产等蓝筹股均有较好的超额收益。宏观经济周期阶段的判断在 2011 年依旧是投资的核心变量，价值投资理念进一步得到强化，中小盘、创业板、极差股跌幅巨大。

根据本基金的基金合同，自 2011 年开始，本基金的股票仓位上限调整为 75%，所以年初的仓位较 2010 年有较大幅度下降。基于对宏观经济形势和股市走势的判断，本基金全年集中配置了大消费类资产，换手率大幅下降。在 12 月份，本基金持有的重庆啤酒股票大幅下跌，我们在重庆啤酒的投资上曾经获得较好的收益，但没有及时适当减持，在后来的下跌过程中对基金净值产生较大冲击。在未来的基金管理中，本基金管理人需要思考如何更好地控制单只股票对基金净值波动的影响。

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 0.626 元，本报告期份额净值增长率为-24.03%，同期业绩比较基准增长率为-8.95%，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

综合各项指标来看，欧洲债务危机日趋恶化并进一步冲击其银行体系和实体经济，美国经济基本面有所好转，国际大宗商品价格大幅震荡，国内经济增速下滑，通货膨胀高位快速回落，企业盈利加速恶化，人民币走势有所反复。但是，就目前的实体经济运行状况和过去半年的货币政策力度来看，通货膨胀在 2012 年上半年将继续回落，房地产价格也将震荡下行，经济增速继续下滑，流动性渐现宽松。基于此，中期经济增长前景非常不明朗，稳增长将成为短期宏观经济运行的主旋律，货币政策和财政政策试探性转向并将持续。过去一段时间的市场总体指数和运行结构及估值水平已经较为充分而前瞻性地反映了宏观经济紧缩政策放松的预期，下阶段有望走出较为相对均衡的走势，不应过于悲观和偏激，但是没有业绩支撑的股票可能面临严峻的局面，价值股超额收益有望持续。

基于国际国内宏观经济基本面、各产业以及上市公司经营业绩、全球流动性及国内流动性、国内资本市场资金流向等因素的分析，本基金管理人认为，2012 年中国股票市场大概率震荡向上，市场表现应显著好于已经过去的 2011 年，但是全年指数大幅上涨的概率不大，投资操作的难度依旧很大，大消费和社会服务业仍旧是 2012 年的主要配置方向，低估值的周期类股票有望提供阶段性的较好收益。

基于以上的分析和判断，在 2012 年，本基金管理人将继续坚持价值投资理念，坚持以“自上而下”的资产配置为主，以“自下而上”的个股选择为辅，动态调整资产组合结构，坚定集中持有行业龙头股票，严格控制基金资产的流动性风险。

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、研究部、固定收益部、风险管理部、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，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金 2011 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容, 应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

报告截止日: 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	613,292,837.33	890,429,297.02
结算备付金	5,591,833.56	9,017,254.81
存出保证金	1,832,984.52	1,250,000.00
交易性金融资产	7,420,465,818.12	9,948,170,916.76
其中: 股票投资	5,552,978,954.22	8,745,654,778.96
基金投资	-	-
债券投资	1,867,486,863.90	1,202,516,137.80
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	800,001,800.00
应收证券清算款	-	40,698,086.68
应收利息	30,018,630.80	9,098,662.53
应收股利	-	-
应收申购款	168,426.76	2,078,880.95
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,071,370,531.09	11,700,744,898.75
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2011 年 12 月 31 日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	60,324,367.70	-
应付赎回款	635,479.82	2,430,379.23
应付管理人报酬	10,132,351.23	14,950,087.79
应付托管费	1,809,348.45	2,491,681.31
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,971,770.13	17,927,803.35

应交税费	34,923.20	6,396.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,719,054.55	1,416,943.90
负债合计	76,627,295.08	39,223,292.38
所有者权益：		
实收基金	12,779,556,841.66	14,149,691,833.39
未分配利润	-4,784,813,605.65	-2,488,170,227.02
所有者权益合计	7,994,743,236.01	11,661,521,606.37
负债和所有者权益总计	8,071,370,531.09	11,700,744,898.75

报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.626 元，基金份额总额 12,779,556,841.66 份。

7.2 利润表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	-2,431,517,723.82	1,526,537,551.30
1. 利息收入	56,422,794.43	14,602,342.46
其中：存款利息收入	5,838,226.38	4,541,442.83
债券利息收入	39,041,820.12	8,435,700.39
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,542,747.93	1,625,199.24
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	236,022,157.09	497,277,079.80
其中：股票投资收益	185,141,846.96	429,004,690.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,133,456.67	2,354,103.54
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	52,013,766.80	65,918,285.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,725,008,430.63	1,013,418,118.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,045,755.29	1,240,010.76
减：二、费用	187,434,369.51	232,086,901.57
1. 管理人报酬	141,276,228.41	155,283,156.85
2. 托管费	25,227,897.90	25,880,526.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	19,238,101.37	49,323,605.85
5. 利息支出	1,154,099.49	1,067,410.93

其中：卖出回购金融资产支出	1,154,099.49	1,067,410.93
6. 其他费用	538,042.34	532,201.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,618,952,093.33	1,294,450,649.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,618,952,093.33	1,294,450,649.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	14,149,691,833.39	-2,488,170,227.02	11,661,521,606.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,618,952,093.33	-2,618,952,093.33
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）	-1,370,134,991.73	322,308,714.70	-1,047,826,277.03
其中：1. 基金申购款	451,462,062.50	-105,088,970.01	346,373,092.49
2. 基金赎回款	-1,821,597,054.23	427,397,684.71	-1,394,199,369.52
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）	12,779,556,841.66	-4,784,813,605.65	7,994,743,236.01
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	15,475,122,618.79	-4,153,359,211.01	11,321,763,407.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,294,450,649.73	1,294,450,649.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,325,430,785.40	370,738,334.26	-954,692,451.14

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	849,140,122.83	-186,474,755.93	662,665,366.90
2. 基金赎回款	-2,174,570,908.23	557,213,090.19	-1,617,357,818.04
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)	14,149,691,833.39	-2,488,170,227.02	11,661,521,606.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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相一致。

7.4.2 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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	896,308,513.48	7.20%	339,525,435.73	1.08%

7.4.3.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
-------	--	---

	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	640,000,000.00	21.69%	-	0.00

7.4.3.1.3 权证交易

无。

7.4.3.1.4 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12月31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	733,975.76	7.08%	-	0.00
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	275,866.65	1.05%	275,866.65	1.54%

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的净额列示。

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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	141,276,228.41
其中：支付销售机构的客户维护费	20,762,933.43	18,071,098.06

注：自基金合同生效日起至 2010 年 12 月 31 日止，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；自 2011 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止，管理费年费率变更为 1.4%。管理费逐日计提，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 管理费年费率 / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	25,227,897.90	25,880,526.19
----------------	---------------	---------------

注：支付基金托管人中国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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	196,218,034.25	-	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.3.4.2 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	613,292,837.33	5,732,548.26	890,429,297.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

7.4.4.1.1 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
000566	海南海药	2011 年 8 月 30 日	2012 年 8 月 31 日	非公开发行流通受限	23.50	20.29	1,000,000	23,500,000.00	20,290,000.00	-

注：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。

7.4.4.2 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
600132	重庆啤酒	2011 年 12 月 23 日	重大事项停牌	28.45	2012 年 1 月 10 日	25.61	6,099,969	134,227,721.00	173,544,118.05	

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,552,978,954.22	68.80
	其中：股票	5,552,978,954.22	68.80
2	固定收益投资	1,867,486,863.90	23.14
	其中：债券	1,867,486,863.90	23.14
	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	618,884,670.89	7.67
6	其他各项资产	32,020,042.08	0.40
7	合计	8,071,370,531.09	100.00

8.2 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	8,897,985.17	0.11
B	采掘业	119,984,119.32	1.50
C	制造业	3,959,438,455.71	49.53
C0	食品、饮料	1,141,509,211.53	14.28
C1	纺织、服装、皮毛	22,740,114.00	0.28
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	74,393,524.70	0.93
C5	电子	415,048,417.28	5.19
C6	金属、非金属	178,407,217.35	2.23
C7	机械、设备、仪表	647,146,267.39	8.09
C8	医药、生物制品	1,480,193,703.46	18.51
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	116,555,943.39	1.46
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	360,510,573.82	4.51
H	批发和零售贸易	288,138,125.80	3.60
I	金融、保险业	382,530,000.00	4.78
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	135,730,000.00	1.70
L	传播与文化产业	181,193,751.01	2.27
M	综合类	-	0.00
	合计	5,552,978,954.22	69.46

8.3 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	600267	海正药业	23,500,000	746,595,000.00	9.34
2	000869	张裕A	2,604,452	281,020,370.80	3.52
3	000423	东阿阿胶	5,999,964	257,698,453.80	3.22
4	002241	歌尔声学	9,999,759	239,994,216.00	3.00

5	000568	泸州老窖	6,000,000	223,800,000.00	2.80
6	600690	青岛海尔	22,000,000	196,460,000.00	2.46
7	600519	贵州茅台	1,000,000	193,300,000.00	2.42
8	000566	海南海药	9,100,000	184,639,000.00	2.31
9	600036	招商银行	15,000,000	178,050,000.00	2.23
10	000858	五粮液	5,408,940	177,413,232.00	2.22

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	315,342,539.68	2.70
2	000858	五粮液	207,143,228.53	1.78
3	601166	兴业银行	198,957,854.90	1.71
4	600519	贵州茅台	182,591,537.01	1.57
5	600585	海螺水泥	178,366,195.04	1.53
6	600859	王府井	176,225,421.69	1.51
7	002142	宁波银行	165,160,178.36	1.42
8	000012	南玻A	142,984,962.19	1.23
9	600267	海正药业	135,718,813.31	1.16
10	000869	张裕A	129,298,099.66	1.11
11	600690	青岛海尔	114,051,812.00	0.98
12	600970	中材国际	108,170,286.37	0.93
13	600425	青松建化	104,799,946.62	0.90
14	600729	重庆百货	101,755,919.83	0.87
15	600000	浦发银行	101,329,900.80	0.87
16	000877	天山股份	94,820,963.01	0.81
17	000157	中联重科	92,518,535.29	0.79
18	600031	三一重工	87,898,742.30	0.75
19	000651	格力电器	86,542,636.90	0.74
20	000969	安泰科技	78,500,010.87	0.67

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁电器	245,003,302.81	2.10
2	600703	三安光电	208,179,908.89	1.79
3	600268	国电南自	187,618,852.87	1.61
4	600887	伊利股份	179,391,216.09	1.54
5	000581	威孚高科	176,788,399.83	1.52
6	000983	西山煤电	176,647,455.34	1.51
7	000568	泸州老窖	163,639,904.83	1.40
8	600585	海螺水泥	143,101,114.24	1.23
9	000338	潍柴动力	140,323,627.46	1.20
10	601699	潞安环能	138,057,449.81	1.18
11	002142	宁波银行	128,008,868.38	1.10
12	000937	冀中能源	122,023,421.34	1.05
13	000848	承德露露	113,989,778.58	0.98
14	600267	海正药业	111,651,497.84	0.96
15	600362	江西铜业	104,249,354.93	0.89
16	601166	兴业银行	103,420,101.60	0.89
17	600880	博瑞传播	103,341,554.57	0.89
18	601717	郑煤机	99,333,961.92	0.85
19	600276	恒瑞医药	97,003,514.34	0.83
20	600406	国电南瑞	88,804,505.13	0.76

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。

8.4.3 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	5,906,717,266.21
卖出股票收入（成交）总额	6,582,576,319.62

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	400,820,000.00	5.01
2	央行票据	729,365,000.00	9.12
3	金融债券	316,217,000.00	3.96
	其中：政策性金融债	316,217,000.00	3.96
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	421,084,863.90	5.27

8	其他	-	0.00
9	合计	1,867,486,863.90	23.36

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101018	11 央行票据 18	6,000,000	580,920,000.00	7.27
2	110015	石化转债	2,108,730	211,948,452.30	2.65
3	113002	工行转债	1,964,460	209,136,411.60	2.62
4	110018	11 付息国债 18	2,000,000	200,820,000.00	2.51
5	110011	11 付息国债 11	2,000,000	200,000,000.00	2.50

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查，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。

2011 年 12 月 28 日，国家环境保护部网站发布了《关于 2011 年环境保护部挂牌督办环境违法案件的通知》（环办[2011]142 号），对包括海正药业在内的 15 家企业环境违法案件挂牌督办。涉及海正药业的问题是：“该公司外排废水 COD 超标排放，电缆沟积存高浓度污水；抗生素菌渣等危险废物擅自出售给无资质的企业；与环境保护部门联网的在线监测数据弄虚作假。”环境保护部责成浙江省环境保护厅依法责令本公司限期治理，处以罚款，在 2012 年 6 月底前完成挂牌督办事项。2012 年 1 月 5 日，海正药业董事会发布提示性公告，对环境保护部督查发现问题及整改情况进行了说明。本基金认为，该处罚不会对海正药业投资价值构成实质性负面影响。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.9.3 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	1,832,984.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,018,630.80
5	应收申购款	168,426.76
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,020,042.08

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110015	石化转债	211,948,452.30	2.65
2	113002	工行转债	209,136,411.60	2.62

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	20,290,000.00	0.25	非公开发行

8.9.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
583,990	21,883.18	58,374,331.43	0.46%	12,721,182,510.23	99.54%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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	77,466.27	0.0006%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006年9月13日) 基金份额总额	1,112,964,439.35
本报告期期初基金份额总额	14,149,691,833.39
本报告期基金总申购份额	451,462,062.50
减:本报告期基金总赎回份额	1,821,597,054.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,779,556,841.66

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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普华永道中天会计师事务所有限公司，本会计期间支付的审计费用为 16.7 万元整。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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国信证券	1	1,399,859,715.94	11.24%	1,137,396.07	10.96%	-
中信证券	2	1,350,020,515.25	10.84%	1,147,514.72	11.06%	-
长江证券	1	1,278,603,361.04	10.27%	1,086,807.87	10.48%	-

东方证券	1	1,162,667,243.55	9.34%	988,263.32	9.53%	-
海通证券	2	985,763,672.74	7.92%	837,895.23	8.08%	-
光大证券	2	896,308,513.48	7.20%	733,975.76	7.08%	-
招商证券	2	749,833,141.17	6.02%	621,648.15	5.99%	-
安信证券	2	591,493,659.38	4.75%	502,767.75	4.85%	-
银河证券	1	539,778,097.00	4.34%	458,809.01	4.42%	-
申银万国	1	423,051,743.72	3.40%	343,732.17	3.31%	-
渤海证券	1	385,555,034.24	3.10%	313,265.45	3.02%	-
华泰联合	1	329,655,819.67	2.65%	267,848.31	2.58%	-
中航证券	1	322,548,586.47	2.59%	262,073.06	2.53%	-
中银国际	1	302,446,157.53	2.43%	245,739.73	2.37%	-
中邮证券	1	299,527,679.92	2.41%	243,367.79	2.35%	-
东莞证券	1	272,993,959.48	2.19%	221,809.76	2.14%	-
财富证券	1	252,026,547.75	2.02%	204,773.36	1.97%	-
江海证券	1	217,572,122.64	1.75%	184,934.79	1.78%	-
广州证券	1	198,603,098.16	1.60%	168,812.02	1.63%	-
天源证券	1	177,881,999.62	1.43%	144,530.17	1.39%	-
中金公司	2	164,127,096.39	1.32%	134,047.39	1.29%	-
华宝证券	1	119,202,990.58	0.96%	96,853.06	0.93%	-
湘财证券	1	31,317,830.11	0.25%	26,619.42	0.26%	-
平安证券	1	-	0.00	-	0.00	-
华泰证券	1	-	0.00	-	0.00	-
国都证券	1	-	0.00	-	0.00	-
国泰君安	1	-	0.00	-	0.00	-
广发证券	1	-	0.00	-	0.00	-
中投证券	2	-	0.00	-	0.00	-

注：1、根据中国证监会颁布的《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。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增席位：海通证券、光大证券、江海证券、广州证券、中投证券、招商证券、天源证券。退租交易单元：银河证券、湘财证券、东方证券、平安证券、中投证券、中信证券。

11.7.2 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
国信证券	4,737,697.46	0.57%	-	0.00	-	0.00
中信证券	419,347,883.70	50.39%	-	0.00	-	0.00
长江证券	-	0.00	1,950,000,000.00	66.10%	-	0.00
东方证券	175,408,566.57	21.08%	-	0.00	-	0.00
海通证券	54,090,999.60	6.50%	300,000,000.00	10.17%	-	0.00
光大证券	-	0.00	640,000,000.00	21.69%	-	0.00
招商证券	91,017.17	0.01%	-	0.00	-	0.00
安信证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
银河证券	32,431,100.00	3.90%	-	0.00	-	0.00
申银万国	-	0.00	-	0.00	-	0.00
渤海证券	20,803,080.43	2.50%	-	0.00	-	0.00
华泰联合	-	0.00	-	0.00	-	0.00
中航证券	2,764,410.41	0.33%	-	0.00	-	0.00
中银国际	-	0.00	-	0.00	-	0.00
中邮证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
东莞证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
财富证券	3,526,505.62	0.42%	-	0.00	-	0.00
江海证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
广州证券	108,103,783.73	12.99%	60,000,000.00	2.03%	-	0.00
天源证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
中金公司	6,374,365.91	0.77%	-	0.00	-	0.00
华宝证券	4,571,433.00	0.55%	-	0.00	-	0.00
湘财证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
平安证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
华泰证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
国都证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
国泰君安	-	0.00	-	0.00	-	0.00
广发证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00
中投证券	-	0.00	-	0.00	-	0.00

大成基金管理有限公司
2012 年 3 月 28 日