大成债券投资基金
2010 年年度报告摘要
2010 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 3 月 31 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 3 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 2010 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	大成债券	
基金主代码	090002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 6 月 12 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	498,350,983.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成债券 A/B	大成债券 C
下属分级基金的交易代码	090002/091002	092002
报告期末下属分级基金的份额总额	255,216,903.16 份	243,134,080.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力保本金安全和保持资产流动性的基础上追求资产的长期稳定增值。
投资策略	通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下地进行投资管理，以实现投资目标。类属资产部分按照修正的均值－方差模型在交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债之间实行最优配置。
业绩比较基准	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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年		2009 年		2008 年	
	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C
本期已实现收益	19,457,359.14	22,823,708.78	26,639,520.57	70,092,651.75	26,966,159.13	42,785,010.88
本期利润	14,316,872.58	26,427,639.18	-2,212,844.38	-29,301,169.30	65,130,612.21	148,166,752.89
加权平均基金份额本期利润	0.0642	0.0740	-0.0061	-0.0325	0.1102	0.1221
本期基金份额净值增长率	6.56%	6.19%	2.72%	2.24%	11.10%	10.56%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末		2009 年末		2008 年末	
	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C	大成债券 A/B	大成债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0508	0.0227	0.0488	0.0259	0.0434	0.0070
期末基金资产净值	268,170,073.60	248,646,770.36	197,698,339.52	271,404,395.53	865,614,206.23	2,488,687,103.80
期末基金份额净值	1.0508	1.0227	1.0488	1.0259	1.0612	1.0437

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

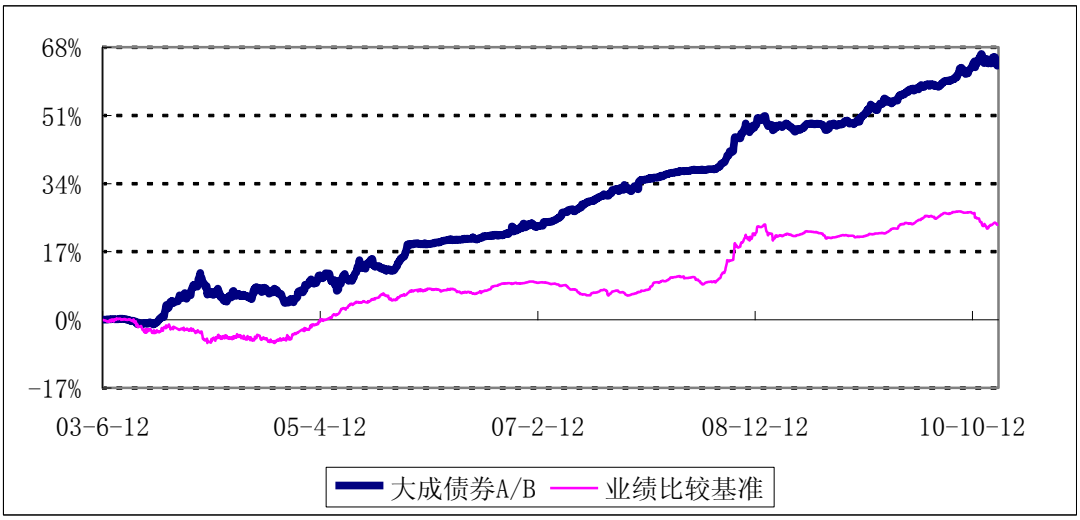
3.2 基金净值表现

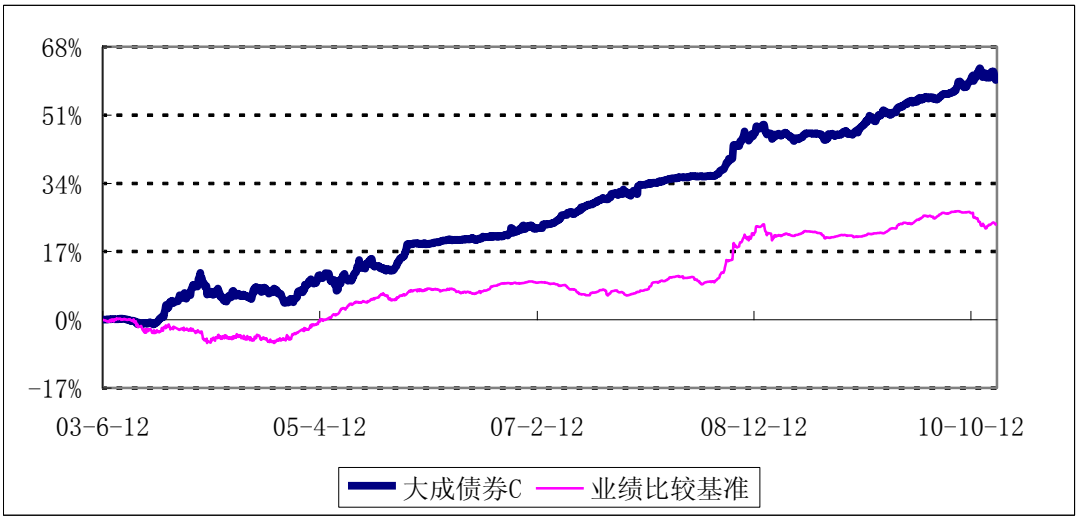
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

份额级别	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
大成债券 A/B	过去三个月	1.20%	0.29%	-2.25%	0.15%	3.45%	0.14%
	过去六个月	3.64%	0.22%	-1.45%	0.12%	5.09%	0.10%
	过去一年	6.56%	0.18%	1.92%	0.10%	4.64%	0.08%
	过去三年	21.61%	0.16%	15.64%	0.15%	5.97%	0.01%

	过去五年	40.61%	0.16%	16.53%	0.13%	24.08%	0.03%
	自基金合同生效起至今	64.01%	0.21%	23.94%	0.20%	40.07%	0.01%
大成债券 C	过去三个月	1.10%	0.29%	-2.25%	0.15%	3.35%	0.14%
	过去六个月	3.46%	0.22%	-1.45%	0.12%	4.91%	0.10%
	过去一年	6.19%	0.18%	1.92%	0.10%	4.27%	0.08%
	过去三年	20.03%	0.16%	15.64%	0.15%	4.39%	0.01%
	过去五年	37.44%	0.16%	16.53%	0.13%	20.91%	0.03%
	自基金合同生效起至今	60.31%	0.21%	23.94%	0.20%	36.37%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

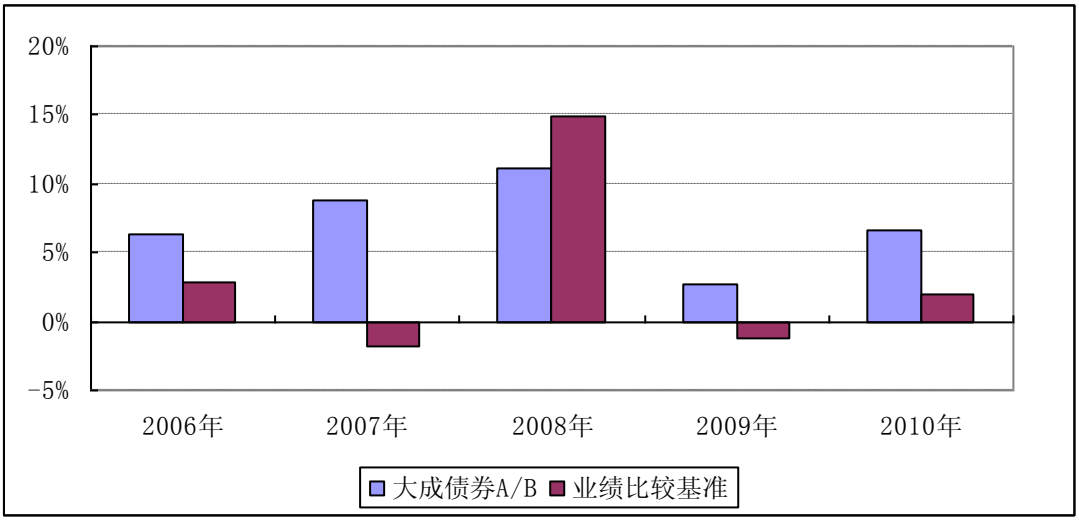


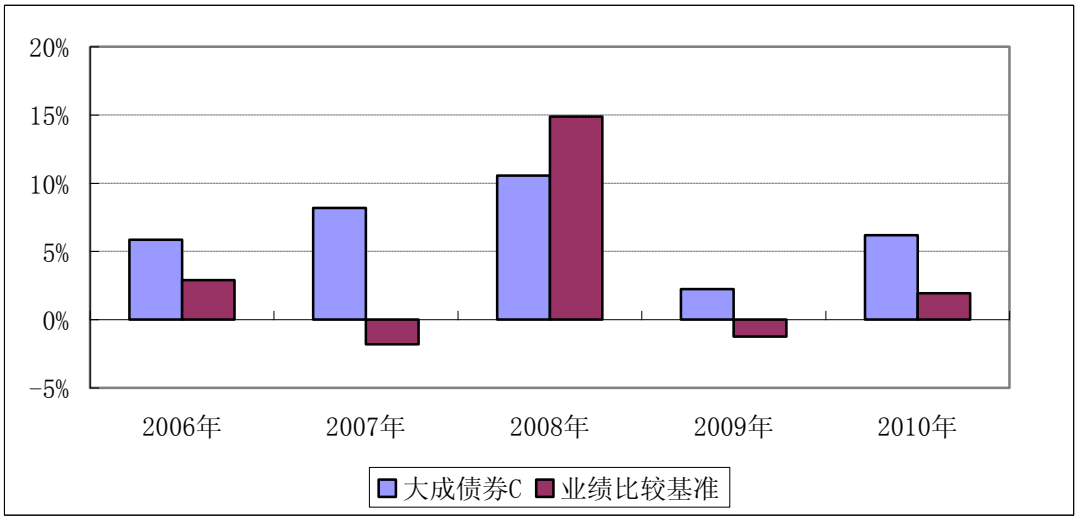


注：1.本基金于 2006 年 4 月 24 日起推出持续性收费模式，将前端收费模式定义为 A 类收费模式，后端收费模式定义为 B 类收费模式，二者对应的基金份额简称“大成债券 A/B”；将持续性收费模式定义为 C 类收费模式，对应的基金份额简称“大成债券 C”。

2.按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例：本基金投资于债券类投资工具的比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

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

大成债券A/B：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010 年	0.650	8,537,661.32	5,643,971.32	14,181,632.64	-
2009 年	0.400	9,165,457.68	5,694,305.68	14,859,763.36	-
2008 年	1.305	42,413,015.98	35,161,729.06	77,574,745.04	-
合计	2.355	60,116,134.98	46,500,006.06	106,616,141.04	-

大成债券C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010 年	0.650	18,776,656.10	4,354,816.36	23,131,472.46	-
2009 年	0.400	41,609,086.42	6,618,778.07	48,227,864.49	-
2008 年	1.305	176,499,356.63	42,310,983.61	218,810,340.24	-
合计	2.355	236,885,099.15	53,284,578.04	290,169,677.19	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托投资有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2010 年 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及 15 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长股票型证券投资基金(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和大成核心双动力股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理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		
王立女士	本基金基金经理	2009 年 5 月 23 日	--	9 年	经济学硕士。曾任职于申银万国证券股份有限公司、南京市商业银行资金营运中心。2005 年 4 月加入大成基金管理有限公司，曾任大成货币市场基金基金经理助理。2007 年 1 月 12 日起担任大成货币市场证券投资基金基金经理。2009 年 5 月 23 日起兼任大成债券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。
徐生沪先生	本基金基金经理助理	2007 年 11 月 26 日	2010 年 6 月 10 日	7 年	经济学学士，曾任职于中国农业银行上海市分行，2003 年加入大成基金管理有限公司，曾任基金运营部登记清算中心主管。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》、《大成债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，大成债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

宏观经济在 2010 年显示出更多的复杂性和不确定性，主要表现在：在海外经济复苏尚不稳固的情况下，货币政策要在“保增长”与“控通胀”之间权衡取舍；房价迅速反弹，资产泡沫风险不断累积；为拉动内需，地方政府以城投企业为平台向银行融资大量上马基建项目，导致地方政府过度负债，中央政府面临两难选择。回望过去一年，平衡上述几个因素以及随之带来的政策频繁变动导致总需求在一年之中经历了增长过强、严重疲软和偏强三种状态，经济周期明显缩短。

经济增长与通胀膨胀仍然是主导 2010 年债券走势的两个基本因素,但收益率的波动明显加大,还与以下三个因素有关:一是通胀的走势,尤其在四季度,CPI 远超出市场的预期；二是货币政策不透明,在政策频繁变动时,市场难以形成稳定的政策预期;三是货币市场资金面较为脆弱,阶段性流动性异常紧张的情况屡屡出现。具体来看，年初经济出现过热苗头，市场对利率品种较为谨慎。而由于信用利差处于历史较高水平，对利率风险提供了一定的利差保护空间，信用品种体现出较高的配置价值。进入二季度，市场对经济增长下滑的担忧加剧，收益率曲线出现牛平。信用债的表现则更加出色，交易所交易活跃的信用债二季度收益率降幅达到 50-70 个基点。三季度随着增长触底反弹的趋势逐步确立，收益率曲线开始陡峭化上行。此外，通胀快速上行成为市场关注的焦点。货币政策在四季度再次转向，央行先后两次上调基准利率，三次上调存款准备金，债市出现大幅下跌，收益率累计升幅超过 100 个基点。信用债受基准利率拖累，也出现大幅调整。

2010 年我们继续执行本基金合同生效以来一直执行的投资策略，即在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作。同时尽量降低基金组合的净值波动率，获得稳定增长的收益。

在资产配置层面上，考虑到上半年传统可转债类资产的风险收益特征基本等同于二级市场股票的特征，我们没有进行该类资产的二级市场配置，仅参与了可转债的一级市场申购。下半年可转债类资产的风险收益特征出现转变，其中中行转债、工行转债等转债品种投资价值凸显。本基金根据市场情况，结合本基金的低

波动风险特征的要求，关注可转债的长期投资价值，增持了部分转股溢价率较低、波动率较低的银行类转债。

由于 2010 年新股发行定价总体偏高，申购新股的风险不断增大，因此我们根据市场情况，逐步减少了参与新股投资的力度。我们结合发行公司基本面、资金成本状况，坚持对首发新股进行估值分析，严格选择、合理询价、高度谨慎参与以提高组合整体收益率，规避投资风险。全年本基金新股投资比例不断降低，截止年底，股票持仓控制在至 5%的范围内，较好地控制了权益类资产的风险及波动。

在债券类资产的投资上，我们基于对宏观经济环境和债券收益率曲线变动预期，继续对组合进行主动管理。在保证流动性的同时，对债券组合结构进行了调整，上半年逐步提高了债券投资组合久期，下半年市场发生转向时，降低组合久期至 2 以下。在具体类别资产选择中，我们减少了对利率品种的投资，加大对信用产品的研究分析，经过对发行公司基本面和发行条款的谨慎选择，我们重点增加了对交易所部分可分离交易债的投资获取较高税后收益。

以上投资操作保持了整体组合的流动性，并在债券收益率曲线调整过程中获得了较高投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，大成债券A/B份额净值增长率为6.56%，大成债券C份额净值增长率为6.19%，同期业绩比较基准增长率为1.92%，基金份额净值增长率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

展望 2011 年，通胀的走势仍然可能是影响债券市场的重要因素，不确定性因素包括海外经济复苏带来的大宗商品价格上涨、劳动力价格上升带来的结构性成本上涨、自然灾害带来的一次性供给冲击等。流动性也可能是影响债市走势的又一重要因素,这既有中国内生的因素，包括准备金达到历史高位导致货币乘数下降，货币派生能力不足使得货币供给更加依赖基础货币的投放；负利率下存款增速下降，银行揽存压力较大等。也有外生的因素，包括海外经济强劲恢复带来的资本回流，可能导致外汇占款少增等。因此相比利率品种，相对确定的收益仍然来自信用债，目前的利差保护能够抵御一定的利率风险。

2011 年我们将继续秉承“在严格控制风险的基础上，采取积极的组合策略和严格的资产选择原则进行投资运作”的操作策略。其中，债券投资组合将充分重视组合的收益性和流动性，重点投资流动性较好的央票和金融债，同时保持较高的信用债投资比例以获取较高的持有期收益。久期策略上，2011 年计划保持较低久期，同时结合市场债券收益率曲线的波动做好主动性管理，寻找机会适当进行波段操作，提高组合收益率。

在可转债和新股投资方面，2011 年本基金将根据市场情况，结合本基金的低波动风险特征的要求，关注可转债的长期投资价值，适度参与二级市场可转债投资。同时我们将继续谨慎参与新股投资。我们结合发行公司基本面、资金成本状况，坚持对首发新股进行估值分析，严格选择、合理询价、高度谨慎参与以提高组合整体收益率，规避投资风险。

我们非常感谢基金份额持有人的长期信任和支持，我们将继续按照债券基金合同和风险收益特征的要求，严格控制投资风险，进一步调整组合结构，研究新的投资品种和挖掘投资机会，力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

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。本报告期内已分配利润 37,313,105.10 元（每十份基金份额分红 0.65 元）。另外，本基金管理人已于 2011 年 1 月 14 日公告以截至 2010 年 12 月 31 日可供分配收益为基准，向本基金份额持有人进行收益分配，A/B 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.33 元，C 类基金按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元,符合基金合同规定的分红比例。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管大成债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《大成债券投资基金基金合同》、《大成债券投资基金托管协议》的约定，对大成债券投资基金管理人—大成基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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债券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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债券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

§6 审计报告

本基金 2010 年年度财务会计报表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：大成债券投资基金
报告截止日： 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	9,059,615.40	46,165,063.29
结算备付金	1,723,700.24	2,460,289.60
存出保证金	183,867.14	410,000.00
交易性金融资产	488,920,525.23	425,047,477.83
其中：股票投资	25,109,033.33	36,342,381.33
基金投资	-	-
债券投资	463,811,491.90	364,705,096.50
资产支持证券投资	-	24,000,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,721,135.35	3,756,445.10
应收股利	-	-
应收申购款	21,820,961.71	1,484,356.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	524,429,805.07	479,323,632.49
负债和所有者权益	**本期末 2010 年 12 月 31 日**	**上年度末 2009 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	-	-
应付赎回款	501,797.92	4,164,793.15
应付管理人报酬	300,800.33	293,211.92
应付托管费	85,942.96	83,774.85
应付销售服务费	59,653.62	75,527.89
应付交易费用	46,997.32	5,877.01
应交税费	6,074,330.55	5,130,175.11
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	543,438.41	467,537.51
负债合计	7,612,961.11	10,220,897.44
所有者权益：		
实收基金	498,350,983.94	453,055,304.25
未分配利润	18,465,860.02	16,047,430.80
所有者权益合计	516,816,843.96	469,102,735.05
负债和所有者权益总计	524,429,805.07	479,323,632.49

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，大成债券 A/B 类基金份额净值 1.0508 元，大成债券 C 类基金份额净值 1.0227 元；基金份额总额 498,350,983.94 份，其中大成债券 A/B 类基金份额 255,216,903.16 份，大成债券 C 类基金份额 243,134,080.78 份。

7.2 利润表

会计主体：大成债券投资基金
本报告期： 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	**49,445,967.36**	**-13,876,664.83**
1.利息收入	12,234,454.51	46,880,944.23
其中：存款利息收入	534,254.56	1,200,939.29
债券利息收入	11,306,255.30	44,044,238.15
资产支持证券利息收入	393,944.65	1,635,766.79
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）	38,516,813.22	66,795,856.19
其中：股票投资收益	32,352,173.36	7,915,096.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,105,457.30	56,944,331.02
资产支持证券投资收益	-	1,664,374.91
衍生工具收益	-	252,628.39
股利收益	59,182.56	19,425.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”	-1,536,556.16	-128,246,186.00

号填列）		
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	231,255.79	692,720.75
减：二、费用	**8,701,455.60**	**17,637,348.85**
1. 管理人报酬	4,224,583.50	9,387,762.66
2. 托管费	1,207,023.84	2,682,217.88
3. 销售服务费	1,107,987.52	2,862,541.48
4. 交易费用	192,689.24	73,532.28
5. 利息支出	1,320,364.26	1,907,572.10
其中：卖出回购金融资产支出	1,320,364.26	1,907,572.10
6. 其他费用	648,807.24	723,722.45
三、利润总额亏损总额以“-”号填列）	**40,744,511.76**	**-31,514,013.68**
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**40,744,511.76**	**-31,514,013.68**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成债券投资基金
本报告期： 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	453,055,304.25	16,047,430.80	469,102,735.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,744,511.76	40,744,511.76
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）	45,295,679.69	-1,012,977.44	44,282,702.25
其中：1. 基金申购款	1,103,910,507.32	37,284,374.76	1,141,194,882.08
2. 基金赎回款	-1,058,614,827.63	-38,297,352.20	-1,096,912,179.83
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）	-	-37,313,105.10	-37,313,105.10
五、期末所有者权益（基金净值）	498,350,983.94	18,465,860.02	516,816,843.96
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 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）	3,200,180,677.19	154,120,632.84	3,354,301,310.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,514,013.68	-31,514,013.68
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）	-2,747,125,372.94	-43,471,560.51	-2,790,596,933.45

其中：1.基金申购款	4,500,752,980.79	118,337,576.83	4,619,090,557.62
2.基金赎回款	-7,247,878,353.73	-161,809,137.34	-7,409,687,491.07
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）	-	-63,087,627.85	-63,087,627.85
五、期末所有者权益（基金净值）	453,055,304.25	16,047,430.80	469,102,735.05

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
中泰信托投资有限责任公司	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
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

无。

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,224,583.50	9,387,762.66
其中：支付给销售机构的客户维护费	390,832.93	1,062,898.23

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,207,023.84	2,682,217.88

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B 类	C 类	合计
大成基金	-	710,502.11	710,502.11
中国农业银行	-	107,324.06	107,324.06
光大证券	-	1,831.37	1,831.37
合计	-	819,657.54	819,657.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B 类	C 类	合计
大成基金	-	1,147,481.74	1,147,481.74
中国农业银行	-	403,694.53	403,694.53
光大证券	-	104.48	104.48
合计	-	1,551,280.75	1,551,280.75

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日持续性销售服务费收费模式下的 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值 X 0.3 % / 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国农业银行	29,719,127.26	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国农业银行	158,638,867.20	121,444,828.37	-	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间2009年1月1日至 2009 年 12 月 31 日

	A/B 类	C 类	A/B 类	C 类
基金合同生效日(2003 年 6 月 12 日)持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-	46,533,271.29
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	-	-	-	-46,533,271.29
期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：基金管理人大成基金在 2009 年度赎回本基金 C 类份额的交易委托招商证券股份有限公司办理，无赎回费。

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

无。

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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间2009年1月1日至 2009 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
中国农业银行	9,059,615.40	499,560.05	46,165,063.29	841,755.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
光大证券	300084	海默科技	首次公开发行	39,613	1,307,229.00
光大证券	300111	向日葵	首次公开发行	283,179	4,757,407.20
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末（2010 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
002493	荣盛石化	10/10/22	11/02/09	新股网下申购	53.80	63.96	141,996	7,639,384.80	9,082,064.16	-
300134	大富科技	10/10/14	11/01/26	新股网下申购	49.50	66.00	102,803	5,088,748.50	6,784,998.00	-
002492	恒基达鑫	10/10/22	11/02/09	新股网下申购	16.00	20.95	209,959	3,359,344.00	4,398,641.05	-

002495	佳隆股份	10/10/22	11/02/09	新股网下申购	32.00	31.57	80,745	2,583,840.00	2,549,119.65	-
300137	先河环保	10/10/27	11/02/09	新股网下申购	22.00	38.21	32,167	707,674.00	1,229,101.07	-
300159	新研股份	10/12/29	11/01/07	新股网上申购	69.98	69.98	500	34,990.00	34,990.00	-
601118	海南橡胶	10/12/30	11/01/07	新股网上申购	5.99	5.99	5,000	29,950.00	29,950.00	-
300156	天立环保	10/12/29	11/01/07	新股网上申购	58.00	58.00	500	29,000.00	29,000.00	-
300157	恒泰艾普	10/12/29	11/01/07	新股网上申购	57.00	57.00	500	28,500.00	28,500.00	-

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。

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
300113	顺网科技	10/12/13	资产重组	69.40	11/01/31	75.98	13,151	565,229.98	912,679.40	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	25,109,033.33	4.79
	其中：股票	25,109,033.33	4.79
2	固定收益投资	463,811,491.90	88.44
	其中：债券	463,811,491.90	88.44
	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	10,783,315.64	2.06
6	其他各项资产	24,725,964.20	4.71
7	合计	524,429,805.07	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	29,950.00	0.01
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	12,925,264.88	2.50
C0	食品、饮料	2,549,119.65	0.49
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	9,082,064.16	1.76
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	1,294,081.07	0.25
C8	医药、生物制品	-	0.00
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	-	0.00
F	交通运输、仓储业	4,398,641.05	0.85
G	信息技术业	7,697,677.40	1.49
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	-	0.00
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	57,500.00	0.01
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	25,109,033.33	4.86

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	002493	荣盛石化	141,996	9,082,064.16	1.76
2	300134	大富科技	102,803	6,784,998.00	1.31
3	002492	恒基达鑫	209,959	4,398,641.05	0.85
4	002495	佳隆股份	80,745	2,549,119.65	0.49
5	300137	先河环保	32,167	1,229,101.07	0.24
6	300113	顺网科技	13,151	912,679.40	0.18
7	300159	新研股份	500	34,990.00	0.01
8	601118	海南橡胶	5,000	29,950.00	0.01
9	300156	天立环保	500	29,000.00	0.01

10	300157	恒泰艾普	500	28,500.00	0.01

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	002493	荣盛石化	7,639,384.80	1.63
2	300134	大富科技	5,088,748.50	1.08
3	300111	向日葵	4,757,407.20	1.01
4	300118	东方日升	4,399,836.00	0.94
5	002492	恒基达鑫	3,359,344.00	0.72
6	300105	龙源技术	3,356,490.00	0.72
7	601179	中国西电	3,192,476.90	0.68
8	300080	新大新材	2,880,371.20	0.61
9	300124	汇川技术	2,859,314.52	0.61
10	002399	海普瑞	2,600,656.00	0.55
11	002495	佳隆股份	2,583,840.00	0.55
12	300048	合康变频	2,483,329.52	0.53
13	300077	国民技术	2,385,512.50	0.51
14	300052	中青宝	2,343,000.00	0.50
15	300115	长盈精密	2,341,178.00	0.50
16	002477	雏鹰农牧	2,047,885.00	0.44
17	002433	太安堂	1,683,458.28	0.36
18	002470	金正大	1,648,815.00	0.35
19	002343	禾欣股份	1,573,901.00	0.34
20	300113	顺网科技	1,420,531.98	0.30

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	300111	向日葵	6,966,347.26	1.49
2	300118	东方日升	6,913,105.31	1.47
3	300105	龙源技术	6,743,207.81	1.44
4	300124	汇川技术	5,102,663.50	1.09
5	300048	合康变频	3,712,784.40	0.79

6	002477	雏鹰农牧	3,335,415.55	0.71
7	300077	国民技术	3,135,756.90	0.67
8	300080	新大新材	3,118,330.00	0.66
9	300115	长盈精密	3,110,400.64	0.66
10	601179	中国西电	2,752,433.13	0.59
11	601299	中国北车	2,683,062.36	0.57
12	300052	中青宝	2,344,859.75	0.50
13	002304	洋河股份	2,285,366.00	0.49
14	002399	海普瑞	2,245,333.20	0.48
15	002470	金正大	2,136,939.50	0.46
16	300011	鼎汉技术	2,130,970.00	0.45
17	002308	威创股份	1,977,564.00	0.42
18	300054	鼎龙股份	1,940,433.24	0.41
19	300120	经纬电材	1,908,049.81	0.41
20	002303	美盈森	1,762,542.02	0.38

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	76,657,413.21
卖出股票收入（成交）总额	112,662,021.92

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	-	0.00
2	央行票据	29,376,000.00	5.68
3	金融债券	150,758,000.00	29.17
	其中：政策性金融债	123,446,000.00	23.89
4	企业债券	185,549,438.90	35.90
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	98,128,053.00	18.99
7	其他	-	0.00
8	合计	463,811,491.90	89.74

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	080218	08 国开 18	800,000	78,344,000.00	15.16

2	126018	08 江铜债	799,910	62,145,007.90	12.02
3	113002	工行转债	419,970	49,615,255.80	9.60
4	113001	中行转债	431,520	47,406,787.20	9.17
5	100234	10 国开 34	400,000	40,164,000.00	7.77

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未出现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。

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	183,867.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,721,135.35
5	应收申购款	21,820,961.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,725,964.20

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	47,406,787.20	9.17

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	002493	荣盛石化	9,082,064.16	1.76	新股网下申购
2	300134	大富科技	6,784,998.00	1.31	新股网下申购
3	002492	恒基达鑫	4,398,641.05	0.85	新股网下申购
4	002495	佳隆股份	2,549,119.65	0.49	新股网下申购
5	300137	先河环保	1,229,101.07	0.24	新股网下申购

6	300113	顺网科技	912,679.40	0.18	资产重组
7	300159	新研股份	34,990.00	0.01	新股网上申购
8	601118	海南橡胶	29,950.00	0.01	新股网上申购
9	300156	天立环保	29,000.00	0.01	新股网上申购
10	300157	恒泰艾普	28,500.00	0.01	新股网上申购

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

份额级别	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
A/B 类	231,943	1,100.34	50,908,260.38	19.95%	204,308,642.78	80.05%
C 类	73,296	3,317.15	103,810,817.16	42.70%	139,323,263.62	57.30%
合计	305,239	1,632.66	154,719,077.54	31.05%	343,631,906.40	68.95%

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	A/B 类	126.67	0.00005%
	C 类	-	-
	合计	126.67	0.00003%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	大成债券 A/B	大成债券 C
基金合同生效日（2003 年 6 月 12 日）基金份额总额	2,152,776,735.13	-
本报告期期初基金份额总额	188,500,218.12	264,555,086.13
本报告期基金总申购份额	266,114,527.86	837,795,979.46
减：本报告期基金总赎回份额	199,397,842.82	859,216,984.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	255,216,903.16	243,134,080.78

§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

经大成基金管理有限公司四届五次董事会审议通过，同意聘任杨春明先生、肖冰先生担任公司副总经理。杨春明先生、肖冰先生的任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可［2010］1557 号文核准。上述任职已于 2010 年 11 月 13 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及本公司网站刊登公告。

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

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，本年度应支付的审计费用为 5.13 万元。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(个)	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	
申银万国	1	9,262,581.60	8.22%	120,000.00	42.34%	-
英大证券	1	49,944,392.85	44.33%	120,000.00	42.34%	-
银河证券	1	53,442,097.47	47.44%	43,421.80	15.32%	
海通证券	1	12,950.00	0.01%	10.52	0.00%	
联合证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
国金证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
中信建投	1	-	0.00%	-	0.00%	
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	
中金公司	1	-	0.00%	-	0.00%	
招商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
兴业证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
合计	15	112,662,021.92	100.00%	283,432.32	100.00%	-

注：1.本报告期内本基金未退租交易单元，新增了银河证券、海通证券、联合证券、国金证券、中信建投、国泰君安、中金公司、招商证券、光大证券、兴业证券、浙商证券、西部证券、华创证券等交易单元。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字<1998>29号)的有关规定，本公司制定了租用券商专用交易单元的选择标准和程序。

租用券商专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面。

租用券商专用交易单元的程序：首先根据租用券商专用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专用交易单元。

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	交易单元数量(个)	债券交易		回购交易		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	
申银万国	1	403,883,301.64	91.60%	5,334,500,000.00	100.00%	-
英大证券	1	29,016,484.71	6.58%	-	0.00%	-
银河证券	1	8,039,631.48	1.82%	-	0.00%	
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
联合证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
国金证券	1	-	0.00%	-	0.00%	

中信建投	1	-	0.00%	-	0.00%	
国泰君安	1	-	0.00%	-	0.00%	
中金公司	1	-	0.00%	-	0.00%	
招商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
兴业证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	
合计	15	440,939,417.83	100.00%	5,334,500,000.00	100.00%	-

大成基金管理有限公司
二〇一一年三月三十一日