

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2011 年半年度报告摘要
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

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。

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 2011 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 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	170,944,774.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

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 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 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3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日)
本期已实现收益	1,357,978.50
本期利润	-1,262,670.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0032
本期基金份额净值增长率	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0139
期末基金资产净值	168,570,884.63
期末基金份额净值	0.986

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 净值表现

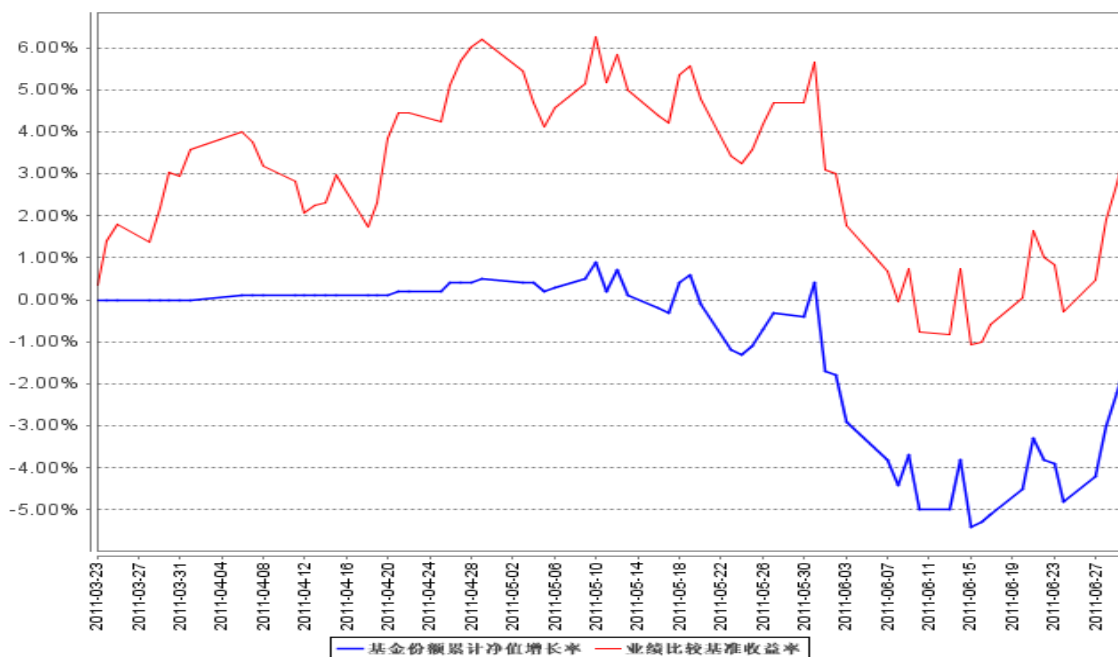
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.79%	1.00%	-1.82%	1.13%	0.03%	-0.13%

过去三个月	-1.40%	0.65%	0.77%	0.85%	-2.17%	-0.20%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.62%	3.72%	0.83%	-5.12%	-0.21%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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、本基金合同于 2011 年 3 月 23 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、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。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 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		
张英辉先生	本基金基金经理	2011 年 3 月 23 日	-	19 年	英国艾克斯特大学金融及投资学硕士。曾任职于高诚资产管理(香港)有限公司、殷诚资产管理(亚洲)有限公司、中国太平洋保险集团资金运用中心、景顺长城基金管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司、国海富兰克林基金管理有限公司、广发资产管理(香港)有限公司、海通资产管理(香港)有限公司。2004 年 9 月 15 日至 2005 年 10 月 11 日曾任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理; 2005 年 4 月 13 日至 2005 年 10 月 11 日曾任上投摩根货币市场基金基金经理; 2006 年 3 月 6 日至 2007 年 3 月 20 日曾任富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。2010 年 3 月加入大成基金管理有限公司国际业务部, 2011 年 3 月 23 日起任大成标普 500 等权重证券投资基金基金经理, 具有基金从业资格。国籍: 中国香港。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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》、《大成标普 500 等权重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, 大成标普 500 等权重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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自 2011 年 3 月 23 日基金合同生效。1 季度末，国际政治经济形势发生了巨大的不利变化。

中东及北非方面，该地区若干产油大国发生激烈的政治动荡，石油产出受到影响，并快速推高原油价格；亚洲方面，日本地震造成了产业链的中断，使得众多行业产能短期受损；欧洲方面，欧债危机阴霾不散，欧洲金融市场持续动荡；美国受制于国债上限的规定及控制财政赤字的需要，政府减少财政支出。

上述各种不利因素使得正在复苏过程中的美国经济受到了较大影响。经过美国商务部最新修正后，美国 2011 年 1 季度 GDP 年化增长率仅为 0.4%，2011 年 2 季度 GDP 年化增长率也仅为 1.3%，远远低于市场的一致预期。数据表明 2008-2009 年的经济衰退程度更深，经济活动尚未恢复至衰退前峰值。

除了个人支出增速减缓的因素之外，政府财政支出的削减亦是造成今年以来经济活动疲弱的重要因素。据估算，今年 1 季度联邦、州和地方政府的开支削减令实际 GDP 折年增速下降了 1 个多百分点；财政政策对今年 2 季度的影响虽然有所减少，但仍为负面影响。

经济增速的降低导致美国股票市场由上涨转为震荡，本基金的基准指数在基金合同生效以来出现较大波动，期间收益率为 3.72%。同期，美元兑人民币汇率持续下跌，相同期间内共下跌 1.34%。

在本报告期间，本基金处于建仓期。根据基金合同，本基金严格依据指数化投资方法逐步增加股票仓位，至报告期末，本基金的股票仓位已经达到了基金合同的要求。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.986 元，本报告期（自基金合同生效至今）基金份额净值增长率为-1.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%，低于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，基金管理人对于 2011 年下半年的美国市场保持相对中性的态度。

造成基金管理人下调对美国宏观经济增长率预期的主要原因是，政府降低财政支出水平及消费者信心的下降已经影响到实体经济。7 月消费信心指标的急剧下滑印证了消费者已经受到失业率居高不下及持久债务上限谈判的影响，而 7 月份制造业 ISM 指数更是急速下降到 50.7%，创出了

金融海啸后的最低水平。众多经济指标已经反映出美国宏观经济增速正在继续放缓，虽然我们预计美国经济不会出现衰退，但这种可能性也不能完全排除。

但是在出现种种不利因素的同时，也仍然有积极因素。从国际方面来看，北非危机及日本地震对美国宏观经济带来的负面影响会逐步减弱，欧债危机也有望得到逐步解决。从美国方面来看，美国国债上限问题已经得到解决，消费者信心指标也有望在不久后有所恢复。另外，如果美国经济持续恶化，美联储推出新的经济刺激计划的可能性也会增大。

综合上述各种因素，基金管理人预计下半年美国经济出现衰退的概率较小，但出现经济强劲增长的可能性也不大。

如果下半年美国经济出现温和增长，企业盈利也会随之小幅增加。当前标普 500 指数的历史市盈率为 13.8 倍左右，2011 年的预期市盈率更是在 13 倍以下，显著低于历史平均水平。因此，在美国经济不出现衰退的情况下，企业盈利的温和增长有望推动标的指数小幅增长。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，继续深入研究更为高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 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。

4.8 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”）在对大成标普 500 等权重指数证券投资基金（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

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合规守信、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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报表（注：财务会计报表中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据真实、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：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	16,203,512.37
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	155,381,918.89
其中：股票投资	155,381,918.89
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	2,103.91
应收股利	190,587.84
应收申购款	55,024.14
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	171,833,147.15
负债和所有者权益	本期末 2011 年 6 月 30 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	2,973,285.61
应付管理人报酬	139,158.86
应付托管费	34,789.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	115,028.36
负债合计	3,262,262.52
所有者权益：	
实收基金	170,944,774.43
未分配利润	-2,373,889.80
所有者权益合计	168,570,884.63
负债和所有者权益总计	171,833,147.15

注：1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.986 元，基金份额总额 170,944,774.43 份。

2、股票投资是指普通股的投资。

6.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日
一、收入	279,213.74
1. 利息收入	2,337,310.01
其中：存款利息收入	2,337,310.01
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	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-27,764.91
其中：股票投资收益	-457,355.64
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	429,590.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,620,648.87

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-228,945.63
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	819,263.14
减：二、费用	1,541,884.11
1. 管理人报酬	1,090,291.61
2. 托管费	272,572.88
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	63,240.02
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	115,779.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,262,670.37
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,262,670.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)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)	822,754,222.26	-	822,754,222.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,262,670.37	-1,262,670.37
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)	-651,809,447.83	-1,111,219.43	-652,920,667.26
其中：1. 基金申购款	2,517,817.46	-28,851.04	2,488,966.42
2. 基金赎回款	-654,327,265.29	-1,082,368.39	-655,409,633.68
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)	170,944,774.43	-2,373,889.80	168,570,884.63

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：

王颢
基金管理公司负责人

刘彩晖
主管会计工作负责人

范瑛
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2010】1876 号文《关于核准大成标普 500 等权重指数证券投资基金募集的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 822,469,878.87 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 091 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 822,754,222.26 份，其中认购资金利息折合 284,343.39 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%—95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%—20%，其中投资于现金或者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%。本基金的业绩比较基准为标普 500 等权重指数（全收益指数）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间系自 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日止会计期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的限期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目上。以公允价值计量的外币非货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的A股股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出 A 股股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入 A 股股票不征收股票交易印花税。

(5) 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税，按照相关国家或地区税收相关法律和法规执行。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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
中泰信托投资有限责任公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,090,291.61
其中：支付销售机构的客户维护费	424,359.90

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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 × 1.0% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	272,572.88	

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	13,986,083.35	2,337,310.01
中银香港	2,217,429.02	0.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	155,381,918.89	90.43
	其中: 普通股股票	155,381,918.89	90.43
	存托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中: 债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中: 远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	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
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	16,203,512.37	9.43
8	其他各项资产	247,715.89	0.14
9	合计	171,833,147.15	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
美国	155,381,918.89	92.18
合计	155,381,918.89	92.18

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
金融	25,276,026.98	14.99

消费者非必需品	24,884,410.97	14.76
信息技术	23,092,537.61	13.70
工业	18,831,722.89	11.17
医疗保健	15,949,691.47	9.46
能源	12,910,069.34	7.66
消费者常用品	12,423,296.06	7.37
公用事业	10,038,935.14	5.96
基础材料	9,518,424.55	5.65
电信服务	2,456,803.88	1.46
合计	155,381,918.89	92.18

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	美国	847	347,797.70	0.21
2	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOYG UQ	纳斯达克交易所	美国	556	342,693.48	0.20
3	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	1,976	342,075.83	0.20
4	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	1,598	341,997.27	0.20
5	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	美国	1,267	341,591.89	0.20
6	Biogen Idec Inc	生物基因	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	491	339,744.24	0.20
7	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UN	纽约交易所	美国	3,117	338,284.06	0.20
8	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	美国	1,615	337,274.23	0.20
9	National Oilwell Varco Inc	美国国民石油	NOV UN	纽约交易所	美国	666	337,091.79	0.20
10	Chipotle Mexican Grill	Chipotle Mexican Grill	CMG UN	纽约交易所	美国	169	337,067.53	0.20

Inc.	股份有限公司						
------	--------	--	--	--	--	--	--

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>) 的半年度报告正文。

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	National Semiconductor	NSM UN	568,202.97	0.34
2	Cephalon Inc	CEPH UQ	462,179.32	0.27
3	Limited Brands Inc	LTD UN	451,808.57	0.27
4	Abercrombie & Fitch Company A	ANF UN	444,196.34	0.26
5	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	439,144.75	0.26
6	Supervalu Inc	SVU UN	428,981.83	0.25
7	Lorillard Inc	LO UN	426,267.54	0.25
8	Dean Foods Co	DF UN	426,107.58	0.25
9	Citrix Systems Inc	CTXS UQ	405,821.30	0.24
10	Alpha Natural Resources	ANR UN	405,569.53	0.24
11	Aetna Inc	AET UN	403,613.01	0.24
12	GameStop Corp A	GME UN	403,331.12	0.24
13	Constellation Brands Inc A	STZ UN	401,281.59	0.24
14	Electronic Arts	ERTS UQ	400,975.52	0.24
15	Bed Bath & Beyond Inc	BBBY UQ	399,397.22	0.24
16	Macys Inc	M UN	398,212.00	0.24
17	Micron Technology Inc	MU UQ	398,163.10	0.24
18	Expedia	EXPE UQ	395,623.48	0.23
19	Tiffany & Co	TIF UN	395,120.92	0.23
20	Wynn Resorts Ltd	WYNN UQ	394,711.13	0.23

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	National Semiconductor	NSM UN	272,760.20	0.16

2	Cephalon Inc	CEPH UQ	162,998.77	0.10
3	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	133,068.01	0.08
4	Expedia	EXPE UQ	122,274.22	0.07
5	Tiffany & Co	TIF UN	119,401.02	0.07
6	Cabot Oil & Gas A	COG UN	117,148.91	0.07
7	GameStop Corp A	GME UN	112,076.46	0.07
8	Forest Laboratories	FRX UN	109,390.49	0.06
9	Lorillard Inc	LO UN	105,920.55	0.06
10	Dean Foods Co	DF UN	97,261.41	0.06
11	Aetna Inc	AET UN	95,915.78	0.06
12	NetFlix Inc	NFLX UQ	95,400.44	0.06
13	Abercrombie & Fitch Company A	ANF UN	94,498.56	0.06
14	CIGNA Corp	CI UN	87,641.84	0.05
15	Electronic Arts	ERTS UQ	86,213.10	0.05
16	Humana Inc	HUM UN	85,274.34	0.05
17	Salesforce.com	CRM UN	84,880.34	0.05
18	Unitedhealth Group Inc	UNH UN	84,386.82	0.05
19	Constellation Energy Group	CEG UN	82,392.72	0.05
20	Thermo Fisher Scientific	TMO UN	82,143.24	0.05

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。

7.5.3 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

买入成本（成交）总额	173,084,872.16
卖出收入（成交）总额	14,576,476.49

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	190,587.84
4	应收利息	2,103.91
5	应收申购款	55,024.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,715.89

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.11.5.1 期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.11.6 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
5,676	30,117.12	7,563,518.54	4.42%	163,381,255.89	95.58%

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	44,468.40	0.03%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期基金总申购份额	2,517,817.46
减：本报告期基金总赎回份额	654,327,265.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,944,774.43

§ 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

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。该人事变动已按相关规定备案并公告。

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普华永道中天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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
高盛证券	1	70,745,175.90	37.70%	3,265.91	33.72%	-
摩根士丹利	1	49,500,435.74	26.38%	2,388.72	24.66%	-
野村证券	1	37,593,140.63	20.03%	1,737.23	17.94%	-
美林证券	1	29,822,596.29	15.89%	2,293.91	23.68%	-
合计	4	187,661,348.56	100.00%	9,685.77	100.00%	

注：1、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、本报告期内本基金无退租的交易单元，新增境内交易单元：长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、光大证券、申银万国、华泰联合证券、中银国际、东莞证券、渤海证券、中邮证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券，新增境外交易单元：高盛证券、摩根士丹利、野村证券、美林证券。

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

无。

大成基金管理有限公司
 二〇一一年八月二十七日