

大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
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 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.....	5
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.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
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.....	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§ 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.....	12
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§ 7 投资组合报告	24
7.1 期末基金资产组合情况.....	24
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	24
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.....	25
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	27
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	28
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.....	29
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.....	29
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.....	29
7.9 投资组合报告附注.....	29
§ 8 基金份额持有人信息	30
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	30
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.....	30
§ 9 开放式基金份额变动	30

§ 10 重大事件揭示	30
10.1 基金份额持有人大会决议.....	30
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.....	31
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	31
10.4 基金投资策略的改变.....	31
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	31
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.....	31
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	31
10.8 其他重大事件.....	33
§ 11 备查文件目录	34
11.1 备查文件目录.....	34
11.2 存放地点.....	34
11.3 查阅方式.....	34

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金
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	13,466,362,340.47 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。

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
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 1 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 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		张树忠	肖钢

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 1 号 中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

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	381, 267, 571. 20
本期利润	-983, 893, 630. 05
加权平均基金份额本期利润	-0. 0714
本期加权平均净值利润率	-9. 21%
本期基金份额净值增长率	-8. 74%
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	-4, 235, 094, 584. 71
期末可供分配基金份额利润	-0. 3145
期末基金资产净值	10, 133, 155, 867. 15
期末基金份额净值	0. 752
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	145. 24%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低

数（为期末余额，不是当期发生数）。

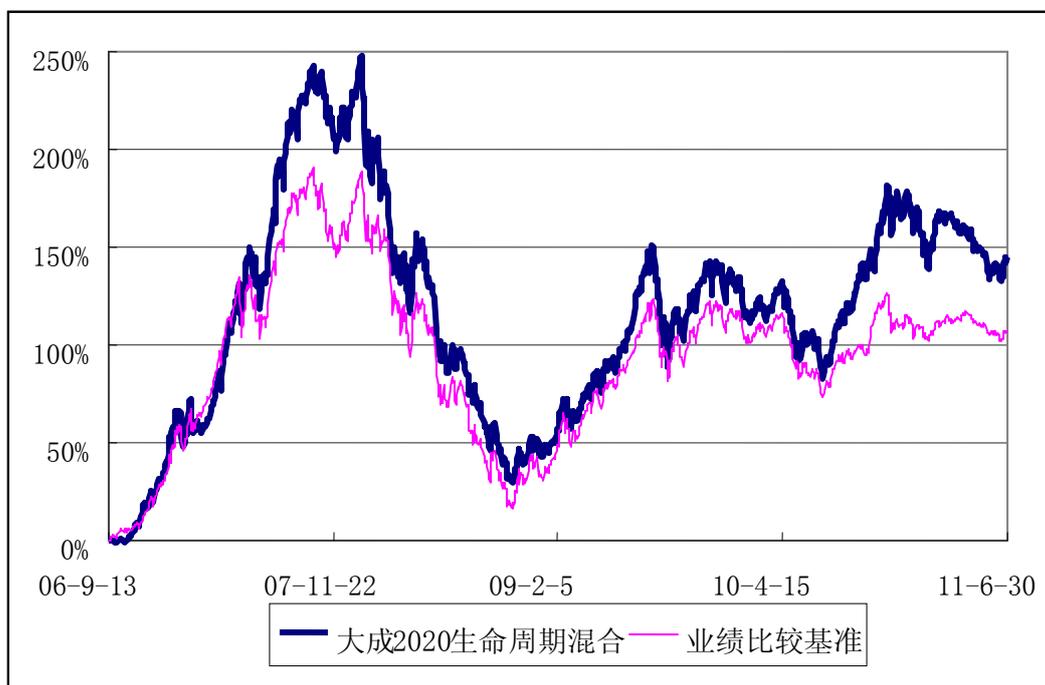
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.16%	0.96%	0.44%	0.55%	2.72%	0.41%
过去三个月	-4.57%	0.89%	-2.26%	0.50%	-2.31%	0.39%
过去六个月	-8.74%	1.06%	-0.45%	0.56%	-8.29%	0.50%
过去一年	29.66%	1.34%	18.01%	0.91%	11.65%	0.43%
过去三年	28.77%	1.63%	20.79%	1.48%	7.98%	0.15%
自基金合同生效起至今	145.24%	1.80%	106.35%	1.62%	38.89%	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变动的比较



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%

§ 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		
曹雄飞先生	本基金基金经理、研究部总监	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、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、市场销售和市場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，具有基金从业资格。国籍：中国
吕猛先生	本基金基金经理助理	2010 年 2 月 25 日	--	4 年	生物医学硕士，曾任职于复旦大学生物医学研究院、长江证券研究所；2008 年加入大成基金管理有限公司，现任行业研究员。2010 年 2 月 25 日起同时担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，本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

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 年上半年，A 股市场沪深 300 指数总体上小幅下跌，但是期间大幅震荡。一季度，先抑后扬，总体小幅上涨。但是，结构分化极为强烈，低估值的周期类股票，尤其是工程机械、水泥、家电、汽车等大幅涨，而 2010 年表现优异，估值较高的新兴产业、医药、消费、电子等股票则大幅下跌。二季度，A 股市场大幅下挫，期间沪深 300 指数由 4 月中旬的高位到 6 月下旬的低位跌幅高达 15% 左右。结构方面，低估值且业绩优异的周期类股票有显著的超额收益，尽管起初有大幅调整，尤其是工程机械、水泥、家电等。与一季度不同的是，二季度，部分消费、医药等稳定类资产以及估值合理的高成长股票投资价值逐步体现，有明显的超额收益。

尽管本基金 2010 年底已经较大幅度减持了部分高估值的小盘股，但是由于根据基金合同要求总仓位也大幅调整，该部分资产在期初仍旧在总仓位中占比较高，导致年初基金净值损失较大。后期基于对宏观经济形势的分析判断，本基金的仓位略有降低，逐步增持了优质周期股和估值合理的高成长股，组合更加均衡，进退相对自如，基金的业绩有所提升。

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 0.752 元，本报告期份额净值增长率为 -8.74%，同期业绩比较基准增长率为 -0.45%，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

我们认为，综合各项指标来看，目前的国际宏观经济基本面开始走弱，国际大宗商品价格有所回落，国内经济在二季度按月计大幅回落，二季度的工业生产增速远低于预期，通货膨胀的巨大压力依然存在。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，通货膨胀的压力在 2011 年下半年尤其是四季度将明显下降。基于此，国内宏观经济尤其是政策层面短期内依旧面临诸多不确定性，依目前的状况判断，在经济增长势头明显回落、通胀压力逐步见顶、紧缩政策持续发酵并有过度紧缩之嫌的三重因素之下，预期货币政策进一步紧缩的压力减少，而近期经济中的部分先行指标已经企稳回升。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均衡的走势，不应过于悲观和偏激。

目前看来，下阶段季度经济基本面将呈现如下特点：美国经济继续减速，海外市场维持弱势，商品价格震荡，部分地区政治风险及债务风险时有发生。国内方面，经济增速继续小幅反弹，通货膨胀触顶，货币政策力度略有调整，本币升值压力加大。下阶段股票市场较清晰的投资主线为受益政策紧缩力度减弱的金融、地产、汽车、工业材料、受益下一代信息技术革命的电子类等，同时要逐步考虑下半年消费、医药、部分新兴产业和主题投资机会。

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，2011 年下半年的中国股票市场大概率上大幅震荡，有所上扬。

基于以上的分析和判断，在 2011 年下半年，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。在资产组合结构方面，适度均衡配置，同时继续通过在大类资产配置之间的权重调整，力求获取适度超额收益。

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

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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 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 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	579,013,283.64	890,429,297.02
结算备付金		5,271,178.37	9,017,254.81
存出保证金		3,787,881.28	1,250,000.00
交易性金融资产	6.4.2.2	9,232,577,172.30	9,948,170,916.76
其中：股票投资		7,550,992,479.98	8,745,654,778.96
基金投资		-	-
债券投资		1,681,584,692.32	1,202,516,137.80
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	297,500,806.25	800,001,800.00
应收证券清算款		17,452,118.19	40,698,086.68
应收利息	6.4.2.5	15,133,450.06	9,098,662.53
应收股利		3,780,000.00	-
应收申购款		97,664.96	2,078,880.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		10,154,613,555.05	11,700,744,898.75
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		-	-
应付赎回款		2,271,211.85	2,430,379.23
应付管理人报酬		11,370,653.97	14,950,087.79
应付托管费		2,030,473.90	2,491,681.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	4,266,562.42	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	6.4.2.8	1,483,862.56	1,416,943.90
负债合计		21,457,687.90	39,223,292.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	13,466,362,340.47	14,149,691,833.39
未分配利润	6.4.2.10	-3,333,206,473.32	-2,488,170,227.02
所有者权益合计		10,133,155,867.15	11,661,521,606.37
负债和所有者权益总计		10,154,613,555.05	11,700,744,898.75

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.752 元，基金份额总额 13,466,362,340.47 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-882,796,796.38	-2,181,095,617.83
1. 利息收入		27,309,002.80	7,039,577.82
其中：存款利息收入	6.4.2.11	3,494,272.12	2,376,348.94
债券利息收入		15,114,856.22	4,032,084.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,699,874.46	631,143.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		454,451,021.84	-195,653,734.37
其中：股票投资收益	6.4.2.12	419,669,440.86	-237,511,701.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	-2,738,897.58	-
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	37,520,478.56	41,857,967.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.16	-1,365,161,201.25	-1,992,842,283.33
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	604,380.23	360,822.05
减：二、费用		101,096,833.67	115,387,444.59
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	74,330,576.30	74,832,007.04
2. 托管费	6.4.5.2.2	13,273,317.13	12,472,001.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.18	12,074,493.55	27,142,034.39
5. 利息支出		1,154,099.49	686,074.11
其中：卖出回购金融资产支出		1,154,099.49	686,074.11
6. 其他费用	6.4.2.19	264,347.20	255,327.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-983,893,630.05	-2,296,483,062.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-983,893,630.05	-2,296,483,062.42

6.3 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 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）	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）	-	-983,893,630.05	-983,893,630.05
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）	-683,329,492.92	138,857,383.75	-544,472,109.17
其中：1. 基金申购款	335,560,110.85	-74,274,218.84	261,285,892.01
2. 基金赎回款	-1,018,889,603.77	213,131,602.59	-805,758,001.18
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）	13,466,362,340.47	-3,333,206,473.32	10,133,155,867.15
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-2,296,483,062.42	-2,296,483,062.42
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）	-519,703,220.15	164,578,544.06	-355,124,676.09
其中：1. 基金申购款	137,198,692.39	-47,103,158.72	90,095,533.67
2. 基金赎回款	-656,901,912.54	211,681,702.78	-445,220,209.76
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）	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	14,955,419,398.64	-6,285,263,729.37	8,670,155,669.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王颢 主管会计工作负责人：刘彩晖 会计机构负责人：范瑛

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	579,013,283.64
定期存款	-
其他存款	-
合计：	579,013,283.64

6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,415,775,933.31	7,550,992,479.98	1,135,216,546.67	
债券	交易所市场	558,193,620.50	558,154,692.32	-38,928.18
	银行间市场	1,126,122,900.00	1,123,430,000.00	-2,692,900.00
	合计	1,684,316,520.50	1,681,584,692.32	-2,731,828.18
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	8,100,092,453.81	9,232,577,172.30	1,132,484,718.49	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场 买入返售金融资产	297,500,806.25	-
合计	297,500,806.25	-

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	82,860.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,134.80
应收债券利息	14,581,709.11
应收买入返售证券利息	466,745.74
应收申购款利息	-
其他	-
合计	15,133,450.06

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	4,255,106.32
银行间市场应付交易费用	11,456.10
合计	4,266,562.42

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	1,250,000.00
应付赎回费	5,751.88
预提费用	228,110.68
合计	1,483,862.56

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	14,149,691,833.39	14,149,691,833.39
本期申购	335,560,110.85	335,560,110.85
本期赎回(以“-”号填列)	-1,018,889,603.77	-1,018,889,603.77
本期末	13,466,362,340.47	13,466,362,340.47

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-4,840,171,698.12	2,352,001,471.10	-2,488,170,227.02
本期利润	381,267,571.20	-1,365,161,201.25	-983,893,630.05
本期基金份额交易产生的变动数	223,809,542.21	-84,952,158.46	138,857,383.75
其中：基金申购款	-108,668,115.32	34,393,896.48	-74,274,218.84
基金赎回款	332,477,657.53	-119,346,054.94	213,131,602.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,235,094,584.71	901,888,111.39	-3,333,206,473.32

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	3,441,232.24
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	50,970.97
其他	2,068.91
合计	3,494,272.12

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	4,070,853,997.28
减：卖出股票成本总额	3,651,184,556.42
买卖股票差价收入	419,669,440.86

6.4.2.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	933,174,193.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	924,864,447.42
减：应收利息总额	11,048,643.99
债券投资收益	-2,738,897.58

6.4.2.14 衍生工具收益
6.4.2.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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	37,520,478.56
基金投资产生的股利收益	-

合计	37,520,478.56
----	---------------

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	-1,365,161,201.25
——股票投资	-1,367,417,114.33
——债券投资	2,255,913.08
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,365,161,201.25

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	580,675.46
转换费	23,704.77
合计	604,380.23

注：1、本基金的赎回费率为赎回金额的 0.3%，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	12,072,043.55
银行间市场交易费用	2,450.00
合计	12,074,493.55

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	79,343.16
信息披露费	148,767.52
银行划款手续费	27,236.52
债券帐户维护费	9,000.00
其他	-
合计	264,347.20

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(“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
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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
光大证券	742,328,446.75	9.42%	-	-

债券回购交易

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	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	91.43%	-	-

6.4.5.1.2 权证交易

无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	607,676.78	9.26%	485,793.63	11.42%
关联方名称	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	74,330,576.30	74,832,007.04
其中：支付销售机构的客户维护费	10,951,657.94	8,685,496.71

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,273,317.13	12,472,001.15

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 X 0.25% / 当年天数。

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

无。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	579,013,283.64	3,441,232.24	903,799,832.10	2,266,547.72

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。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 利润分配情况

无。

6.4.7 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
600011	华能国际	10/12/29	11/12/23	非公开发行	5.57	5.28	5,000,000	27,850,000.00	26,400,000.00	-
300223	北京君正	11/5/25	11/8/31	新股网下申购	43.80	40.86	250,000	10,950,000.00	10,215,000.00	-

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。

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

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.3.2 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。

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

本基金是一只生命周期型基金，目标日期为 2020 年 12 月 31 日。从建仓期结束起至目标日期止，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型基金；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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家上市公司的股票其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券总和不超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产本基金的基金管理人均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	579,013,283.64	-	-	-	579,013,283.64
结算备付金	5,271,178.37	-	-	-	5,271,178.37
存出保证金	-	-	-	3,787,881.28	3,787,881.28
交易性金融资产	1,673,424,106.70	8,160,585.62	-	7,550,992,479.98	9,232,577,172.30
买入返售金融资产	297,500,806.25	-	-	-	297,500,806.25
应收证券清算款	-	-	-	17,452,118.19	17,452,118.19
应收利息	-	-	-	15,133,450.06	15,133,450.06
应收股利	-	-	-	3,780,000.00	3,780,000.00
应收申购款	164.02	-	-	97,500.94	97,664.96
资产总计	2,555,209,538.98	8,160,585.62		7,591,243,430.45	10,154,613,555.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,271,211.85	2,271,211.85
应付管理人报酬	-	-	-	11,370,653.97	11,370,653.97
应付托管费	-	-	-	2,030,473.90	2,030,473.90
应付交易费用	-	-	-	4,266,562.42	4,266,562.42
应交税费	-	-	-	34,923.20	34,923.20
其他负债	-	-	-	1,483,862.56	1,483,862.56
负债总计				21,457,687.90	21,457,687.90
利率敏感度缺口	2,555,209,538.98	8,160,585.62		7,569,785,742.55	10,133,155,867.15
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
2010年12月31日					
资产					
银行存款	890,429,297.02	-	-	-	890,429,297.02
结算备付金	9,017,254.81	-	-	-	9,017,254.81
存出保证金	-	-	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	1,001,883,675.00	5,761,500.00	194,870,962.80	8,745,654,778.96	9,948,170,916.76
买入返售金融资产	800,001,800.00	-	-	-	800,001,800.00
应收证券清算款	-	-	-	40,698,086.68	40,698,086.68
应收利息	-	-	-	9,098,662.53	9,098,662.53
应收申购款	16,974.56	-	-	2,061,906.39	2,078,880.95
资产总计	2,701,349,001.39	5,761,500.00	194,870,962.80	8,798,763,434.56	11,700,744,898.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,430,379.23	2,430,379.23
应付管理人报酬	-	-	-	14,950,087.79	14,950,087.79
应付托管费	-	-	-	2,491,681.31	2,491,681.31
应付交易费用	-	-	-	17,927,803.35	17,927,803.35
应交税费	-	-	-	6,396.80	6,396.80
其他负债	-	-	-	1,416,943.90	1,416,943.90
负债总计				39,223,292.38	39,223,292.38

利率敏感度缺口	2,701,349,001.39	5,761,500.00	194,870,962.80	8,759,540,142.18	11,661,521,606.37
---------	------------------	--------------	----------------	------------------	-------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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. 市场利率下降 25 个基点	增加约 638	无重大影响
2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 627	无重大影响	

6.4.8.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	7,550,992,479.98	74.52	8,745,654,778.96	75.00
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,550,992,479.98	74.52	8,745,654,778.96	75.00

6.4.8.4.3.2 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 80,260	增加约 68,068
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 81,633	减少约 68,068

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	7,550,992,479.98	74.36
	其中：股票	7,550,992,479.98	74.36
2	固定收益投资	1,681,584,692.32	16.56
	其中：债券	1,681,584,692.32	16.56
	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	297,500,806.25	2.93
	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	584,284,462.01	5.75
6	其他资产	40,251,114.49	0.40
7	合计	10,154,613,555.05	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	456,588,796.35	4.51
C	制造业	5,485,817,502.80	54.14
C0	食品、饮料	1,439,813,810.57	14.21
C1	纺织、服装、皮毛	15,756,952.80	0.16
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	4,497,411.80	0.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	345,847,471.00	3.41
C5	电子	546,295,886.66	5.39
C6	金属、非金属	626,773,168.06	6.19
C7	机械、设备、仪表	849,486,829.61	8.38
C8	医药、生物制品	1,657,345,972.30	16.36
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	26,400,000.00	0.26
E	建筑业	34,872,615.60	0.34
F	交通运输、仓储业	-	0.00

G	信息技术业	395,585,449.06	3.90
H	批发和零售贸易	288,693,852.73	2.85
I	金融、保险业	441,577,433.88	4.36
J	房地产业	118,776,829.56	1.17
K	社会服务业	131,680,000.00	1.30
L	传播与文化产业	171,000,000.00	1.69
M	综合类	-	0.00
	合计	7,550,992,479.98	74.52

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	600267	海正药业	24,106,760	900,146,418.40	8.88
2	600132	重庆啤酒	9,000,000	516,600,000.00	5.10
3	601699	潞安环能	9,000,000	295,290,000.00	2.91
4	600036	招商银行	21,735,594	282,997,433.88	2.79
5	600690	青岛海尔	9,499,957	265,523,798.15	2.62
6	002241	歌尔声学	9,999,759	253,793,883.42	2.50
7	000568	泸州老窖	5,200,000	234,624,000.00	2.32
8	000423	东阿阿胶	5,500,000	226,930,000.00	2.24
9	600519	贵州茅台	952,831	202,600,455.53	2.00
10	600703	三安光电	12,000,000	196,800,000.00	1.94
11	600585	海螺水泥	6,674,541	185,285,258.16	1.83
12	000566	海南海药	8,199,950	182,284,888.50	1.80
13	000869	张裕A	1,700,000	167,960,000.00	1.66
14	002106	莱宝高科	5,319,946	160,928,366.50	1.59
15	600406	国电南瑞	4,400,000	159,720,000.00	1.58
16	002230	科大讯飞	3,449,773	139,715,806.50	1.38
17	000858	五粮液	3,499,833	125,014,034.76	1.23
18	600859	王府井	2,992,898	119,626,133.06	1.18
19	000661	长春高新	2,500,000	118,750,000.00	1.17
20	000937	冀中能源	4,299,980	109,004,493.00	1.08
21	002453	天马精化	3,199,626	107,187,471.00	1.06
22	600537	海通集团	2,800,000	102,536,000.00	1.01
23	300027	华谊兄弟	7,000,000	100,800,000.00	0.99
24	000826	桑德环境	4,000,000	99,720,000.00	0.98
25	002142	宁波银行	9,000,000	97,920,000.00	0.97
26	300029	天龙光电	4,029,550	91,914,035.50	0.91

27	600729	重庆百货	2,000,003	86,440,129.66	0.85
28	000877	天山股份	2,399,869	85,291,344.26	0.84
29	600549	厦门钨业	2,000,000	82,860,000.00	0.82
30	600362	江西铜业	2,300,000	81,512,000.00	0.80
31	002123	荣信股份	3,399,925	77,450,291.50	0.76
32	600079	人福医药	3,500,000	77,210,000.00	0.76
33	600880	博瑞传播	5,000,000	70,200,000.00	0.69
34	600048	保利地产	5,999,762	65,937,384.38	0.65
35	601717	郑煤机	1,800,000	65,628,000.00	0.65
36	000157	中联重科	3,999,936	61,519,015.68	0.61
37	000629	攀钢钒钛	5,499,802	60,882,808.14	0.60
38	601166	兴业银行	4,500,000	60,660,000.00	0.60
39	002329	皇氏乳业	3,292,000	59,683,960.00	0.59
40	600993	马应龙	3,100,000	58,962,000.00	0.58
41	600418	江淮汽车	4,999,721	55,546,900.31	0.55
42	600031	三一重工	2,999,880	54,117,835.20	0.53
43	002261	拓维信息	3,000,000	53,610,000.00	0.53
44	600376	首开股份	3,999,958	52,839,445.18	0.52
45	000962	东方钨业	2,000,000	49,900,000.00	0.49
46	000630	铜陵有色	2,000,000	48,200,000.00	0.48
47	600460	士兰微	2,500,000	42,475,000.00	0.42
48	000422	湖北宣化	2,000,000	41,860,000.00	0.41
49	600535	天士力	999,896	41,125,722.48	0.41
50	002456	欧菲光	1,500,000	41,025,000.00	0.40
51	600497	驰宏锌锗	1,819,787	40,126,303.35	0.40
52	002475	立讯精密	1,049,879	37,858,636.74	0.37
53	600104	上海汽车	1,999,907	37,478,257.18	0.37
54	002081	金螳螂	867,478	34,872,615.60	0.34
55	300015	爱尔眼科	1,000,000	31,960,000.00	0.32
56	002376	新北洋	1,700,000	31,229,000.00	0.31
57	600587	新华医疗	907,802	29,349,238.66	0.29
58	000538	云南白药	499,999	28,539,942.92	0.28
59	600011	华能国际	5,000,000	26,400,000.00	0.26
60	002024	苏宁电器	1,967,625	25,205,276.25	0.25
61	300048	合康变频	1,200,000	23,880,000.00	0.24
62	300105	龙源技术	504,000	23,829,120.00	0.24
63	600521	华海药业	1,650,000	23,397,000.00	0.23
64	600268	国电南自	1,800,000	23,040,000.00	0.23
65	002419	天虹商场	989,996	21,344,313.76	0.21

66	600765	中航重机	1,399,950	20,999,250.00	0.21
67	000987	广州友谊	1,000,000	20,990,000.00	0.21
68	600673	东阳光铝	1,199,943	19,211,087.43	0.19
69	002124	天邦股份	1,999,852	19,178,580.68	0.19
70	000807	云铝股份	1,700,000	18,292,000.00	0.18
71	002154	报喜鸟	1,175,892	15,756,952.80	0.16
72	002091	江苏国泰	800,000	15,088,000.00	0.15
73	600888	新疆众和	599,990	14,549,757.50	0.14
74	000933	神火股份	800,000	12,168,000.00	0.12
75	600298	安琪酵母	349,903	11,616,779.60	0.11
76	000063	中兴通讯	399,952	11,310,642.56	0.11
77	300223	北京君正	250,000	10,215,000.00	0.10
78	002303	美盈森	129,983	4,497,411.80	0.04

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	600036	招商银行	315,342,539.68	2.70
2	600519	贵州茅台	182,591,537.01	1.57
3	002142	宁波银行	165,160,178.36	1.42
4	600585	海螺水泥	163,070,471.09	1.40
5	000858	五粮液	120,763,767.66	1.04
6	601166	兴业银行	107,155,357.36	0.92
7	600425	青松建化	104,799,946.62	0.90
8	000877	天山股份	94,820,963.01	0.81
9	000157	中联重科	92,518,535.29	0.79
10	600859	王府井	91,903,087.76	0.79
11	600267	海正药业	83,054,086.89	0.71
12	000629	攀钢钒钛	71,522,157.10	0.61
13	600690	DR 青岛海	69,179,665.89	0.59
14	000422	湖北宜化	66,802,432.59	0.57
15	600418	江淮汽车	65,196,411.35	0.56
16	000937	冀中能源	63,827,590.32	0.55
17	600048	保利地产	62,585,022.15	0.54
18	600031	三一重工	62,187,919.57	0.53

19	600339	天利高新	57,705,477.90	0.49
20	601601	中国太保	53,515,791.59	0.46

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

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

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	002024	苏宁电器	224,746,509.15	1.93
2	600887	伊利股份	179,391,216.09	1.54
3	000983	西山煤电	176,647,455.34	1.51
4	000581	威孚高科	170,332,756.24	1.46
5	600268	国电南自	163,793,699.63	1.40
6	000568	泸州老窖	163,639,904.83	1.40
7	000338	潍柴动力	140,323,627.46	1.20
8	000848	承德露露	113,989,778.58	0.98
9	600276	恒瑞医药	97,003,514.34	0.83
10	600425	青松建化	87,993,989.42	0.75
11	600089	特变电工	85,799,912.53	0.74
12	600406	国电南瑞	85,504,505.13	0.73
13	600352	浙江龙盛	84,421,100.52	0.72
14	600707	彩虹股份	84,412,315.20	0.72
15	600880	博瑞传播	67,258,379.18	0.58
16	600479	千金药业	66,507,711.96	0.57
17	600339	天利高新	66,240,579.85	0.57
18	000858	五粮液	66,006,221.13	0.57
19	600549	厦门钨业	55,043,817.23	0.47
20	600778	友好集团	54,485,506.48	0.47

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,823,939,371.77
卖出股票收入（成交）总额	4,070,853,997.28

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

1	国家债券	288,718,000.00	2.85
2	央行票据	774,900,000.00	7.65
3	金融债券	149,650,000.00	1.48
	其中：政策性金融债	149,650,000.00	1.48
4	企业债券	8,160,585.62	0.08
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	460,156,106.70	4.54
8	其他	-	0.00
9	合计	1,681,584,692.32	16.59

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101018	11 央行票据 18	6,000,000	579,540,000.00	5.72
2	113002	工行转债	1,964,460	232,729,576.20	2.30
3	110015	石化转债	2,108,730	227,426,530.50	2.24
4	110011	11 付息国债 11	2,000,000	198,880,000.00	1.96
5	1001077	10 央行票据 77	2,000,000	195,360,000.00	1.93

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

7.9.2 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。

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	3,787,881.28
2	应收证券清算款	17,452,118.19
3	应收股利	3,780,000.00
4	应收利息	15,133,450.06
5	应收申购款	97,664.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	40,251,114.49

7.9.4 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	232,729,576.20	2.30

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不存在流通受限的情况。

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
604,752	22,267.58	194,605,096.20	1.45%	13,271,757,244.27	98.55%

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	77,466.27	0.0006%

§ 9 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	335,560,110.85
减:本报告期基金总赎回份额	1,018,889,603.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,466,362,340.47

§ 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	2	1,197,420,540.60	15.19%	1,017,805.56	15.51%	-
海通证券	2	850,331,745.90	10.79%	722,778.05	11.01%	-
国信证券	1	841,021,108.73	10.67%	683,336.22	10.41%	-
光大证券	2	742,328,446.75	9.42%	607,676.78	9.26%	-
东方证券	1	676,893,684.98	8.59%	575,357.77	8.77%	-
银河证券	1	423,646,332.02	5.37%	360,097.51	5.49%	-
申银万国	1	423,051,743.72	5.37%	343,732.17	5.24%	-
安信证券	2	420,544,407.31	5.33%	357,461.46	5.45%	-
中航证券	1	322,548,586.47	4.09%	262,073.06	3.99%	-
招商证券	2	320,639,095.98	4.07%	260,519.79	3.97%	-
渤海证券	1	318,886,632.92	4.04%	259,097.04	3.95%	-
东莞证券	1	272,993,959.48	3.46%	221,809.76	3.38%	-
广州证券	1	198,603,098.16	2.52%	168,812.02	2.57%	-
中银国际	1	169,988,990.38	2.16%	138,117.19	2.10%	-

江海证券	1	168,863,961.45	2.14%	143,533.41	2.19%	-
中金公司	2	164,127,096.39	2.08%	134,047.39	2.04%	-
中邮证券	1	164,120,496.20	2.08%	133,348.48	2.03%	-
华宝证券	1	119,202,990.58	1.51%	96,853.06	1.48%	-
长江证券	1	57,312,620.92	0.73%	48,715.89	0.74%	-
湘财证券	1	31,317,830.11	0.40%	26,619.42	0.41%	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
合计	33	7,883,843,369.05	100.00%	6,561,792.03	100.00%	

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	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
中信证券	419,347,883.70	50.89%	-	-
海通证券	54,090,999.60	6.56%	-	-
国信证券	-	-	-	-
光大证券	-	-	640,000,000.00	91.43%
东方证券	175,408,566.57	21.29%	-	-
银河证券	32,431,100.00	3.94%	-	-
申银万国	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-
中航证券	2,764,410.41	0.34%	-	-
招商证券	91,017.17	0.01%	-	-
渤海证券	20,803,080.43	2.52%	-	-
东莞证券	-	-	-	-
广州证券	108,103,783.73	13.12%	60,000,000.00	8.57%
中银国际	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-
中金公司	6,374,365.91	0.77%	-	-
中邮证券	-	-	-	-
华宝证券	4,571,433.00	0.55%	-	-

长江证券				
湘财证券				
联合证券				
华泰证券				
国都证券				
国泰君安				
财富证券				
中投证券				
合计	823,986,640.52	100.00%	700,000,000.00	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，新增席位：光大证券、江海证券、广州证券、中投证券、招商证券。退租席位：银河证券、湘财证券、东方证券、平安证券、中投证券、中信证券。

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	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011年3月31日
8	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金	中国证监会指定报刊	2011年4月1日

	网上银行申购费率优惠活动的补充公告	及本公司网站	
9	关于旗下开放式基金参加华夏银行基金网上银行申购费率优惠活动的补充公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 6 日
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	关于旗下部分基金增加北京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 6 月 24 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金的文件;
- (二) 《大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金合同》;
- (三) 《大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金托管协议》;
- (四) 大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
- (五) 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