基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2012年8月25日

# 大成核心双动力股票型证券投资基金

## 【2012】半年度报告摘要

### §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年08月20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2012年01月01日起至06月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成核心双动力股票 |
| 基金主代码 | 090011 |
| 交易代码 | 090011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年6月22日 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 219,751,819.33份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 大成基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杜鹏 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008885558 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83199588 | 010-66105798 |

2.4 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<br>北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行托管业务部 |

### §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(2012年1月1日 - 2012年6月30日 ) |
| 本期已实现收益 | -5,968,430.62 |
| 本期利润 | 8,174,259.69 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0363 |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.65% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2012年6月30日 ) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2660 |
| 期末基金资产净值 | 173,181,739.65 |
| 期末基金份额净值 | 0.788 |

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。

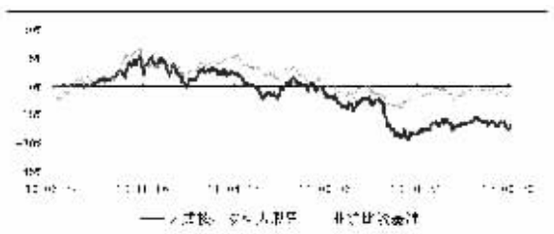
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -3.79% | 1.02% | -4.78% | 0.81% | 0.99% | 0.21% |
| 过去三个月 | 1.68% | 1.00% | 0.82% | 0.83% | 0.86% | 0.17% |
| 过去六个月 | 4.65% | 1.21% | 4.65% | 0.99% | 0.00% | 0.22% |
| 过去一年 | -20.48% | 1.18% | -12.86% | 1.01% | -7.62% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -21.20% | 1.15% | -6.10% | 1.04% | -15.10% | 0.11% |

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字【1999】10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司（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2012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21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、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨建华先生 | 本基金基金经理 | 2010年6月22日 | - | 12年 | 工商管理硕士，经济学博士研究生。曾任光大证券研究所研究员、四川启明星投资公司总经理助理。2004年4月加入大成基金管理有限公司，2006年1月-2008年1月期间曾任大成价值增长证券投资基金基金经理。2005年2月起开始担任景阳证券投资基金（2007年12月11日封转开为大成景阳领先股票型证券投资基金）基金经理。2010年6月22日起兼任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。 |
| 徐雄晖先生 | 本基金基金经理助理 | 2010年6月22日 | - | 5年 | 经济学硕士，2008年加入大成基金管理有限公司，主要负责商业、服装、旅游行业研究，2010年2月25日起担任大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理助理，并于2010年6月22日起兼任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理助理。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。

3、因工作需要，大成基金管理有限公司决定聘请孙蓓琳女士为大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理，杨建华先生不再担任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。上述变更事项已于2012年7月28日公开披露。

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》、《大成核心双动力股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成核心双动力股票型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2012年上半年，公司旗下主动投资组合间股票交易存在两笔同日反向交易，与市场成交情况比较，两笔交易成交均价与市场均价不存在明显差异，且同日反向交易成交较少的单边交易量占该股当日市场成交量比例均低于1%。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，其中参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的情况有3次，原因是指数型投资组合投资策略需要；投资组合间存在债券同日反向交易，但投资组合间的交易价格比较一致，与市场成交均价较为接近，且各投资组合成交量占市场成交量比例不足5%，基于此公司认为，投资组合间债券的同日反向交易不存在异常交易行为；相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常；而投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，投资组合间不存在利益输送的可能性。

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

2012年以来，虽然市场对经济复苏充满期待，但实际经济运行趋势明显低于预期。受1-2月企业补库存的影响，经济有所回升，但3月以后，国内外需求持续低迷，经济增长不断低于预期。受制于庞大的货币存量，虽然政府在2季度多次表态将稳增长放在更重要的位置，但并未推出配套的产业性政策。工业增加值增速不断下滑，PPI持续为负，量价齐跌背景下，上半年企业盈利普遍低于预期。6月初，央行三年来首次降息，为中长期的经济企稳埋下伏笔。

市场方面，上半年沪深300指数上涨4.9%，上证指数上涨1.2%，但期间波动幅度较大。分行业看，房地产、有色、食品饮料涨幅居前，而通信、能源跌幅明显。具体到基金操作上，小幅下降了仓位，同时对持仓结构也进行了一定的调整。增持了销售持续向好的地产以及受益资本市场制度变革的证券、保险。出于对经济复苏低于预期的担忧，我们对煤炭、化工等周期性板块进行了减持。

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0.788元，本报告期份额净值增长率为4.65%，同期业绩比较基准增长率为4.65%，与业绩比较基准持平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，看好受益于降息的利率敏感类资产。基于资金面宽松的判断，预期风险溢价将下降，成长股存在更多的投资机会，各行业及细分行业具备特质的龙头为我们重要的研究对象。我们将秉承为持有人负责的宗旨，勤勉敬业，精选个股，力求为持有人贡献更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、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

2012年上半年，本基金托管人在对大成核心双动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年上半年，大成核心双动力股票型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成核心双动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成核心双动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成核心双动力股票型证券投资基金2012年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2012年6月30日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 35,582,924.15 | 30,384,304.23 |
| 结算备付金 | 229,277.89 | 1,068,395.36 |
| 存出保证金 | 83,333.34 | 582,884.03 |
| 交易性金融资产 | 140,219,605.57 | 144,343,990.89 |
| 其中：股票投资 | 140,219,605.57 | 144,343,990.89 |
| 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 | 646,091.56 | 125,626.01 |
| 应收利息 | 5,727.95 | 7,302.22 |
| 应收股利 | 7,192.62 | - |
| 应收申购款 | 22,512.82 | 4,553.67 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 176,796,665.90 | 176,517,056.41 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2012年6月30日 | 上年度末 2011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 | 2,573,418.76 | 4,270,053.85 |
| 应付赎回款 | 14,195.78 | 317,292.88 |
| 应付管理人报酬 | 217,643.33 | 329,909.22 |
| 应付托管费 | 36,273.88 | 54,984.86 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 339,370.50 | 712,676.00 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 434,024.00 | 631,169.18 |
| 负债合计 | 3,614,926.25 | 6,316,085.99 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 219,751,819.33 | 226,049,985.85 |
| 未分配利润 | -46,570,079.68 | -55,849,015.43 |
| 所有者权益合计 | 173,181,739.65 | 170,200,970.42 |
| 负债和所有者权益总计 | 176,796,665.90 | 176,517,056.41 |

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.788元，基金份额总额219,751,819.33份。

6.2 利润表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 10,535,905.44 | -83,143,298.24 |
| 1.利息收入 | 96,607.63 | 623,179.98 |
| 其中：存款利息收入 | 96,607.63 | 623,179.98 |
| 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) | -3,713,775.91 | -56,685,125.91 |
| 其中：股票投资收益 | -4,562,285.78 | -61,446,934.94 |
| 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 | 848,509.87 | 4,761,809.03 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 14,142,690.31 | -27,823,921.71 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 10,383.41 | 742,569.40 |
| 减：二、费用 | 2,361,645.75 | 13,712,921.89 |
| 1.管理人报酬 | 1,327,171.38 | 7,726,028.56 |
| 2.托管费 | 221,195.25 | 1,287,671.45 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 618,586.38 | 4,486,940.31 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 194,692.74 | 212,281.57 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 8,174,259.69 | -96,856,220.13 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 8,174,259.69 | -96,856,220.13 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成核心双动力股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012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) | 226,049,985.85 | -55,849,015.43 | 170,200,970.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 8,174,259.69 | 8,174,259.69 |
| 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） | -6,298,166.52 | 1,104,676.06 | -5,193,490.46 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,867,215.39 | -1,925,149.07 | 6,942,066.32 |
| 2.基金赎回款 | -15,165,381.91 | 3,029,825.13 | -12,135,556.78 |
| 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) | 219,751,819.33 | -46,570,079.68 | 173,181,739.65 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,024,888,900.33 | 102,010,179.32 | 1,126,899,079.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -96,856,220.13 | -96,856,220.13 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -121,973,678.90 | -13,340,870.31 | -135,314,549.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 435,823,006.60 | 23,564,002.15 | 459,387,008.75 |
| 2.基金赎回款 | -557,796,685.50 | -36,904,872.46 | -594,701,557.96 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 902,915,221.43 | -8,186,911.12 | 894,728,310.31 |

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：王颖　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 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 大成基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 光大证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中泰信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 广东证券股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国银河投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：1、中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,327,171.38 | 7,726,028.56 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 451,969.44 | 696,553.59 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 221,195.25 | 1,287,671.45 |

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

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2010年6月22日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 13.65% | 3.32% |

注：本基金管理人投资本基金的费率标准严格按照法律法规及交易所相关规定计算并支付。

6.4.3.4.2 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。

6.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 35,582,924.15 | 93,925.96 | 107,516,866.94 | 593,821.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.3.6 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。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.4 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### §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 | 140,219,605.57 | 79.31 |
| | 其中：股票 | 140,219,605.57 | 79.31 |
| 2 | 固定收益投资 | - | 0.00 |
| | 其中：债券 | - | 0.00 |
| | 资产支持证券 | - | 0.00 |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | 0.00 |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 35,812,202.04 | 20.26 |
| 6 | 其他各项资产 | 764,858.29 | 0.43 |
| 7 | 合计 | 176,796,665.90 | 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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | 0.00 |
| B | 采掘业 | 6,411,217.32 | 3.70 |
| C | 制造业 | 88,362,283.63 | 51.02 |
| C0 | 食品、饮料 | 33,225,065.23 | 19.19 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 5,726,570.35 | 3.31 |
| C2 | 木材、家具 | - | 0.00 |
| C3 | 造纸、印刷 | - | 0.00 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,560,569.76 | 0.90 |
| C5 | 电子 | 9,382,530.25 | 5.42 |
| C6 | 金属、非金属 | 6,170,900.00 | 3.56 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 25,351,648.04 | 14.64 |
| C8 | 医药、生物制品 | 6,945,000.00 | 4.01 |
| 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 | - | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 7,238,562.24 | 4.18 |
| H | 批发和零售贸易 | - | 0.00 |
| I | 金融、保险业 | 16,708,065.46 | 9.65 |
| J | 房地产业 | 16,402,063.40 | 9.47 |
| K | 社会服务业 | 5,097,413.52 | 2.94 |
| L | 传播与文化产业 | - | 0.00 |
| M | 综合类 | - | 0.00 |
| | 合计 | 140,219,605.57 | 80.97 |

7.3 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 | 600519 | 贵州茅台 | 50,000 | 11,957,500.00 | 6.90 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 500,000 | 10,425,000.00 | 6.02 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 300,000 | 9,828,000.00 | 5.68 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 159,879 | 7,312,865.46 | 4.22 |
| 5 | 600406 | 国电南瑞 | 387,296 | 7,238,562.24 | 4.18 |
| 6 | 000776 | 广发证券 | 160,000 | 4,772,800.00 | 2.76 |
| 7 | 600518 | 康美药业 | 300,000 | 4,626,000.00 | 2.67 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 480,000 | 4,622,400.00 | 2.67 |
| 9 | 000937 | 冀中能源 | 299,916 | 4,579,717.32 | 2.64 |
| 10 | 600549 | 厦门钨业 | 100,000 | 4,391,000.00 | 2.54 |

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 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 | 600549 | 厦门钨业 | 10,469,973.64 | 6.15 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 6,878,539.46 | 4.04 |
| 3 | 600970 | 中材国际 | 5,511,630.55 | 3.24 |
| 4 | 000937 | 冀中能源 | 5,477,877.52 | 3.22 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 5,240,776.05 | 3.08 |
| 6 | 000671 | 阳 光 城 | 5,102,837.15 | 3.00 |
| 7 | 000776 | 广发证券 | 5,079,254.20 | 2.98 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 4,880,977.54 | 2.87 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 4,311,323.13 | 2.53 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 4,194,222.53 | 2.46 |
| 11 | 000527 | 美的电器 | 4,107,977.71 | 2.41 |
| 12 | 601699 | 潞安环能 | 3,927,102.22 | 2.31 |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 3,846,709.75 | 2.26 |
| 14 | 600143 | 金发科技 | 3,756,616.45 | 2.21 |
| 15 | 000869 | 张 裕A | 3,719,171.82 | 2.19 |
| 16 | 600177 | 雅戈尔 | 3,707,008.95 | 2.18 |
| 17 | 000401 | 冀东水泥 | 3,657,973.70 | 2.15 |
| 18 | 600704 | 物产中大 | 3,651,972.48 | 2.15 |
| 19 | 000926 | 福星股份 | 3,575,114.00 | 2.10 |
| 20 | 000024 | 招商地产 | 3,514,829.07 | 2.07 |
| 21 | 601100 | 恒立油缸 | 3,490,034.01 | 2.05 |
| 22 | 600239 | 云南城投 | 3,479,152.00 | 2.04 |
| 23 | 600682 | 南京新百 | 3,471,786.00 | 2.04 |
| 24 | 002154 | 报 喜 鸟 | 3,455,655.05 | 2.03 |
| 25 | 600383 | 金地集团 | 3,435,846.00 | 2.02 |

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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 | 600036 | 招商银行 | 12,880,886.96 | 7.57 |
| 2 | 600125 | 铁龙物流 | 8,997,658.77 | 5.29 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 8,457,799.00 | 4.97 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 7,746,010.26 | 4.55 |
| 5 | 600123 | 兰花科创 | 7,429,934.80 | 4.37 |
| 6 | 600518 | 康美药业 | 7,416,226.62 | 4.36 |
| 7 | 600549 | 厦门钨业 | 7,116,746.43 | 4.18 |
| 8 | 600859 | 王府井 | 6,961,044.57 | 4.09 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 6,161,566.77 | 3.62 |
| 10 | 600970 | 中材国际 | 5,446,319.80 | 3.20 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 5,353,893.83 | 3.15 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 5,339,000.00 | 3.14 |
| 13 | 002081 | 金 螳 螂 | 4,231,703.87 | 2.49 |
| 14 | 600239 | 云南城投 | 4,227,853.00 | 2.48 |
| 15 | 600108 | 亚盛集团 | 4,134,204.74 | 2.43 |
| 16 | 601699 | 潞安环能 | 4,091,590.00 | 2.40 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 4,076,733.91 | 2.40 |
| 18 | 600682 | 南京新百 | 3,980,612.00 | 2.34 |
| 19 | 600517 | 置信电气 | 3,930,722.11 | 2.31 |
| 20 | 600066 | 宇通客车 | 3,801,135.55 | 2.23 |
| 21 | 000401 | 冀东水泥 | 3,766,094.89 | 2.21 |
| 22 | 000869 | 张 裕A | 3,724,132.62 | 2.19 |

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 194,120,133.63 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 207,824,923.48 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

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未