大成积极成长股票型证券投资基金

2010 年度报告摘要

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
报告送出日期:2011年3月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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	大成积极成长股票
基金主代码	519017
交易代码	519017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月16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	2,955,243,574.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在优化组合投资基础上,主要投资于有良好成长潜力的上市公司,尽可能规避投资风险,谋求基金财产长期增值。
投资策略	本基金主要根据GDP增长率、工业增加值变化率、固定资产投资趋势、A股市场平均市盈率及其变化趋势、真实汇率、外贸顺差、消费者价格指数CPI增长率、M2、信贷增长率及增长结构等指标以及国家政策的变化,对宏观经济及证券市场的总体变动趋势进行定量、定性分析,作出资产配置决策。本基金还力争通过财务指标分析、成长型筛选、估值比较、实地调研等深入、科学的基本面分析,挖掘具有良好成长性的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司,属于中高风险的证券投资基金品种。

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基金托管部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	299,514,484.14	611,661,939.18	-720,742,742.74
本期利润	362,682,880.32	1,491,323,345.48	-3,500,649,370.01
加权平均基金份额本期利润	0.1274	0.4268	-0.8724
本期基金份额净值增长率	12.85%	64.30%	-54.32%
3.1.2 期末数据和指标	**2010 年末**	**2009 年末**	**2008 年末**
期末可供分配基金份额利润	0.1676	0.0402	-0.3671
期末基金资产净值	3,450,474,375.42	3,184,409,691.05	2,416,040,391.48
期末基金份额净值	1.168	1.040	0.633

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。

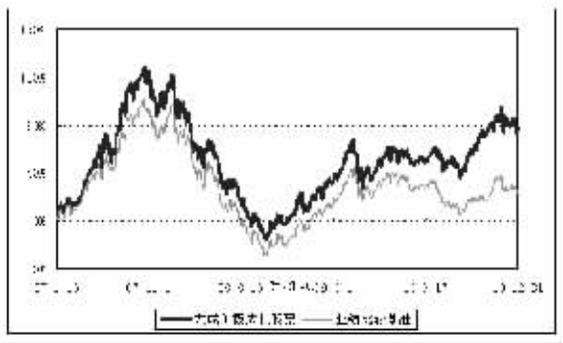
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.21%	1.58%	5.04%	1.42%	-3.83%	0.16%
过去六个月	27.51%	1.41%	17.42%	1.24%	10.09%	0.17%
过去一年	12.85%	1.34%	-9.26%	1.27%	22.11%	0.07%
过去三年	-15.30%	1.83%	-32.58%	1.87%	17.28%	-0.04%
自基金合同生效起至今	79.12%	1.87%	25.18%	1.84%	53.94%	0.03%

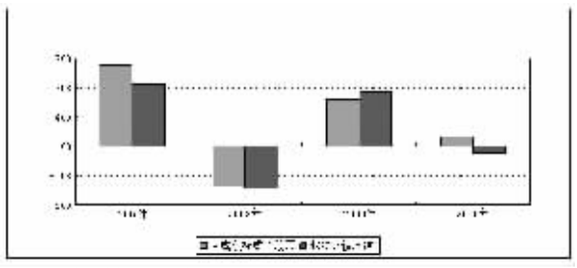
3.2.2 自基金转型生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、按基金合同规定,大成积极成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至本报告期本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

2、本基金业绩比较基准收益率的历史走势图从2007年1月15日(基金合同生效暨基金转型日)至2009年2月1日为原业绩比较基准(新华富时600成长指数收益率×80%+新华雷曼中国全债指数收益率×20%)的走势图,2009年2月2日起为变更后的业绩比较基准的走势图。

3.2.3 自基金转型生效以来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

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	0.0500	8,454,742.70	6,623,557.18	15,078,299.88	2009年度收益分配
2009	-	-	-	-	-
2008	3.5000	797,314,109.74	558,609,246.17	1,355,923,355.91	-
合计	3.5500	805,768,852.44	565,232,803.35	1,371,001,655.79	-

§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(5%)、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(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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
周建春先生	本基金基金经理	2009 年 9 月 24日	--	13年	管理工程硕士。1998年1月—1999年9月,任职于湖南省国际信托投资公司基金管理部,证券管理总部,从事投资和研究工作;1999年10月加入大成基金管理有限公司,历任高级研究员、景博证券投资基金经理助理、景博证券投资基金基金经理(2002年1月11日—2004年3月31日)、景福证券投资基金经理助理。2008年11月26日起担任大成策略回报股票型基金基金经理。2009年9月24日起兼任大成积极成长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。
刘洋女士	本基金基金经理助理	2009 年 10 月 12日	--	3年	工商管理硕士,2007年7月加入大成基金管理有限公司从事研究工作,现任行业研究员。2009年10月起同时担任本基金和大成积极成长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。

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》、《大成积极成长股票型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成积极成长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

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

阶段	基金	净值增长率
2010年	大成积极成长股票型证券投资基金	12.85%
	大成创新成长混合型证券投资基金	4.44%
	大成景阳领先股票型证券投资基金	20.40%

报告期内,大成积极成长股票型证券投资基金和大成景阳领先股票型证券投资基金净值增长率差异为-7.55%,其中-1.28%来自行业配置,-6.67 %来自个股选择,0.4%来自资产配置及其他因素;大成积极成长股票型证券投资基金和大成创新成长混合型证券投资基金净值增长率差异为8.41%,其中7.38%来自行业配置,0.25%来自个股选择,0.78%来自资产配置及其他因素。

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

2010年我国经济继续保持平稳快速增长,经济运行态势良好,全年国内生产总值增长10.3%,环比呈现探底回升态势,物价指数增长3.3%,略超年初预期。2010年初经济快速回升,有局部过热迹象,政府开始实施宏观调控政策,导致经济增长环比逐步回落,政府适时放松了调控的力度,由于四季度通胀水平超出市场预期,政府继续出台了调控房地产行业、提高存款准备金和利率以及严控银行信贷等系列措施。从全年看,政策一直围绕确保经济平稳增长,促进经济结构转型和控制通胀水平三者之间寻求平衡发展。

2010年证券市场表现与经济增长和政策方向基本一致,市场整体呈探底回升走势,但结构分化明显,上半年医药、消费等稳定类行业表现良好,下半年新兴产业的投资机会较多;总体看小市值股票表现好于大市值股票,稳定类行业表现好于周期性行业,新兴产业表现好于传统产业。

本基金全年保持较高股票仓位水平,年初加大了医药、食品饮料和新兴产业的配置力度,大幅降低了周期性行业配置比例,同时精选稳定成长型个股并坚定持有;随着调控政策的放松,我们在下半年适当增加了新兴产业和部分低估值的周期性行业配置比例。

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1.168元,本报告期份额净值增长率为12.85%,同期业绩比较基准增长率为-9.26%,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

2010年全球经济走出衰退的困境,预计2011年将步入正常增长轨道,美国个人收入的回升为消费增长提供了坚实基础,信贷环境逐步康复将进一步推升消费的增长率,我们预计美国经济可能超预期增长。国内经济仍处扩张时期,由于我国正处于工业化、城市化与现代化多重叠加的发展阶段, 经济增长的内涵在发生深刻的变化,2010年收入和消费增长势头比往年更加强劲, 说明了我国经济正在由投资和出口拉动向三者均衡发展。当前通胀水平处于较高水平,短期难以缓解,预计2011年宏观政策取向将是前紧后松,货币紧缩将贯穿上半年,未来几个月仍存在加息和多次上调存款准备金率的可能;如果通胀水平出现明显回落,下半年货币政策将缓和。

展望2011年证券市场,上半年由于通胀高企,调控政策紧密出台,这将制约市场的上涨;根据WIND一致盈利预测,当前沪深300的2011年的PE为13倍多,对应2011年盈利增速20%左右,该估值水平与历史估值区间比较,属于偏低估值水平,指数也很难出现深幅调整空间,预计上半年市场在区间振荡。如果通胀水平回落,政策和经济增长逐步明朗,下半年可能存在较好的投资机会,但全球通胀水平是否大幅上升具有不确定性。在行业配置层面,2011年市场难以出现明显的结构性机会,主要原因是行业前景良好的新兴产业板块整体估值水平过高,存在透支的可能;传统产业中蓝筹股估值优势明显,但是受制于政策紧缩估值水平也很难大幅提升。我们认为两个方向存在较好的投资机会:一是由于中低端劳动力短缺导致人力成本大幅上升,机器替代人的进程仍在加快,先进制造业和装备行业将得到快速发展;二是继续看好长期受益于经济结构转型、收入结构变化和人口红利的医药、食品饮料等行业,以及估值合理的新兴产业中的成长型公司。对于2011年的市场环境,我们将在行业配置上相对均衡,更加注重自下而上的个股研究,将风险控制和绝对收益放在投资的首位,努力获取良好的收益水平。

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。本报告期内本基金已分配利润15,078,299.88元(每十份基金份额分红0.05元),符合基金合同规定的分红比例。本报告期末本基金可供分配收益为495,230,801.17元,本基金已于2011年1月17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,每10份基金份额派发现金红利0.61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

在托管大成积极成长股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成积极成长股票型证券投资基金基金合同》、《大成积极成长股票型证券投资基金托管协议》的约定,对大成积极成长股票型证券投资基金管理人—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积极成长股票型证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积极成长股票型证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。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2011年3月25日

§6 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

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	473,160,024.76	192,838,900.09
结算备付金	11,060,451.07	9,558,677.81
存出保证金	2,162,779.12	2,731,889.35
交易性金融资产	2,945,263,404.22	2,980,598,247.38
其中:股票投资	2,938,254,883.36	2,980,598,247.38
基金投资	-	-
债券投资	7,008,520.86	-
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	39,356,623.61	35,837,283.15
应收利息	88,571.19	43,951.79
应收股利	-	-
应收申购款	449,630.16	78,437.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,884,512.64	2,884,512.64
资产总计	3,474,425,996.77	3,224,571,899.28
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	5,020,944.39	13,858,886.76
应付赎回款	629,366.63	7,097,610.31
应付管理人报酬	4,210,296.82	4,022,840.41
应付托管费	701,716.15	670,473.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,366,763.63	10,484,940.26
应交税费	236,858.58	236,858.58
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,785,675.15	3,790,598.52
负债合计	23,951,621.35	40,162,208.23
所有者权益:		
实收基金	2,955,243,574.25	3,061,325,526.08
未分配利润	495,230,801.17	123,084,164.97
所有者权益合计	3,450,474,375.42	3,184,409,691.05
负债和所有者权益总计	3,474,425,996.77	3,224,571,899.28

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.168元,基金份额总额2,955,243,574.25份。

7.2 利润表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

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	436,329,479.85	1,574,751,924.88
1.利息收入	2,859,709.25	6,498,843.02
其中:存款利息收入	2,848,690.11	2,437,408.66
债券利息收入	11,019.14	4,061,434.36
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)	370,060,232.63	688,311,038.97
其中:股票投资收益	355,780,029.62	650,723,539.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	294,825.34	11,487,619.91
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,985,377.67	26,099,879.87
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	63,168,396.18	879,661,406.30
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	241,141.79	280,636.59
减:二、费用	73,646,599.53	83,428,579.40
1.管理人报酬	44,808,758.47	46,121,348.31
2.托管费	7,468,126.39	7,686,891.34
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	20,924,481.00	29,180,396.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	445,233.67	439,943.35
三、利润总额	362,682,880.32	1,491,323,345.48
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	362,682,880.32	1,491,323,345.48

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成积极成长股票型证券投资基金

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)	3,061,325,526.08	123,084,164.97	3,184,409,691.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	362,682,880.32	362,682,880.32
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)	-106,081,951.83	24,542,055.76	-81,539,896.07
其中:1.基金申购款	710,570,759.48	99,876,006.63	810,446,766.11
2.基金赎回款	-816,652,711.31	-75,333,950.87	-891,986,662.18
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)	-	-15,078,299.88	-15,078,299.88
五、期末所有者权益(基金净值)	2,955,243,574.25	495,230,801.17	3,450,474,375.42
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)	3,817,667,707.13	-1,401,627,315.65	2,416,040,391.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,491,323,345.48	1,491,323,345.48
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)	-756,342,181.05	33,388,135.14	-722,954,045.91
其中:1.基金申购款	162,183,816.58	-18,432,353.30	143,751,463.28
2.基金赎回款	-918,525,997.63	51,820,488.44	-866,705,509.19
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)	3,061,325,526.08	123,084,164.97	3,184,409,691.05

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:王颇 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、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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	1,485,675,996.77	10.90%	5,132,771,676.03	26.96%

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	1,207,122.32	10.60%	3,320,595.52	35.45%
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	4,234,742.24	26.51%	3,053,385.04	29.12%

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

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

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 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	44,808,758.47	46,121,348.31
其中:支付给销售机构的客户维护费	8,492,404.43	8,127,328.71

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。

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	7,468,126.39	7,686,891.34

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0.25%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。

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

无。

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
基金合同生效日(2007年1月16日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	34,573,260.00	34,573,260.00
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	34,573,260.00	34,573,260.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.17%	1.13%

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	473,160,024.76	2,765,842.37	192,838,900.09	2,344,698.10

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

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
600703	三安光电	10/10/15	11/10/13	非公开发行	30.00	33.75	1,000,000	30,000,000.00	33,750,000.00	-
601118	海南橡胶	10/12/30	11/04/07	新股网下申购	5.99	5.99	369,463	2,213,083.37	2,213,083.37	-
601933	永辉超市	10/12/09	11/03/15	新股网下申购	23.98	31.24	24,732	593,073.36	772,627.68	-
601126	四方股份	10/12/28	11/03/31	新股网下申购	23.00	31.11	21,586	496,478.00	671,540.46	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	10/12/06	资产重组	37.13	未知	未知	2,199,855	79,916,188.06	81,680,616.15	-

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	2,938,254,883.36	84.57
	其中:股票	2,938,254,883.36	84.57
2	固定收益投资	7,008,520.86	0.20
	其中:债券	7,008,520.86	0.20
	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	484,220,475.83	13.94
6	其他各项资产	44,942,116.72	1.29
7	合计	3,474,425,996.77	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	51,606,622.47	1.50
B	采掘业	29,887,795.02	0.87
C	制造业	2,191,384,090.18	63.51
C0	食品、饮料	755,262,541.89	21.89
C1	纺织、服装、皮毛	67,824,608.00	1.97
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	310,918,172.22	9.01
C5	电子	44,427,219.11	1.29
C6	金属、非金属	104,746,166.46	3.04
C7	机械、设备、仪表	366,541,735.18	10.62
C8	医药、生物制品	541,663,647.32	15.70
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	82,056,278.88	2.38
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	217,131,750.81	6.29
I	金融、保险业	243,778,226.09	7.07
J	房地产业	77,117,799.09	2.23
K	社会服务业	45,292,320.82	1.