景福证券投资基金

【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
送出日期:2011年3月31日

§1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")根据本基金合同规定,于2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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日至12月31日

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成景福封闭
基金主代码	184701
交易代码	184701
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年12月30日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2000年1月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过指数化投资和积极投资的有机组合,实现投资风险和收益的优化平衡,力求使基金取得超过市场的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的指数投资部分采用分层抽样法,选择代表上证A股市场整体特征的股票构建投资组合;积极投资部分则投资于高成长行业或价值低估行业的股票。整体投资力求超越基准指数表现。

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@defund.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.defund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司
	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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	580,918,316.81	913,850,753.68	39,781,333.46
本期利润	777,371,186.49	1,870,005,938.82	-3,935,733,318.89
加权平均基金份额本期利润	0.2591	0.6233	-1.3119
本期基金份额净值增长率	20.32%	62.40%	-50.71%
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	0.2350	0.4213	-0.0012
期末基金资产净值	4,503,787,581.54	4,866,416,395.05	2,996,410,456.23
期末基金份额净值	1.5013	1.6221	0.9988

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。

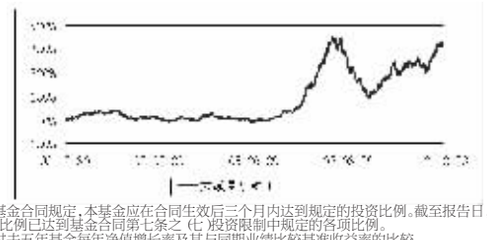
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

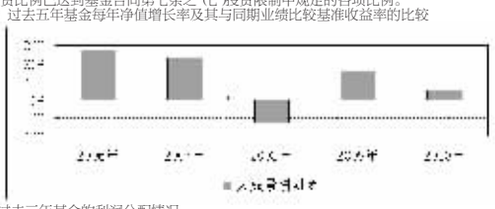
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.72%	2.47%	-	-	-	-
过去六个月	33.88%	2.56%	-	-	-	-
过去一年	20.32%	2.68%	-	-	-	-
过去三年	-3.69%	3.41%	-	-	-	-
过去五年	295.29%	3.34%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	314.68%	2.76%	-	-	-	-

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,本基金应在合同生效后三个月内达到规定的投资比例。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第七条之(七)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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	3.800	1,140,000,000.00	-	1,140,000,000.00	2009年度收益分配
2009	-	-	-	-	
2008	7.600	2,280,000,000.00	-	2,280,000,000.00	2007年度收益分配
合计	11.400	3,420,000,000.00	-	3,420,000,000.00	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准,于1999年4月12日正式成立,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。目前公司由四家股东组成,分别为中泰信托投资有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2010年12月31日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金;1只ETF及1只ETF联接基金:深证成长40ETF及大成深证成长40ETF联接基金;1只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金及15只开放式证券投资基金:大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长股票型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金和大成核心双动力股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(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		
杨丹先生	本基金基金经理	2008年8月23日	--	10年	理学硕士,2001年加入大成基金管理有限公司,先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部。2006年5月27日开始担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2008年8月23日开始兼任景福证券投资基金基金经理。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》、《景福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,景福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,目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历了2009年强劲的经济复苏以后,全球各主要经济体开始回归常态,货币政策正常化成为2010全年经济最明确的趋势。以中国为代表的新兴市场经济体在2009年的全球经济复苏中功不可没,但同时各国宽松的货币也给未来的持续通胀埋下了伏笔,流动性回收成为政策选择的必然。在全球经济再平衡的大格局下,中国经济不得不由出口导向转变为内需驱动,经济转型是大势所趋。因此,在经济增速下滑与通胀压力逐步显现的双重制约下,2010年中国的经济走势波动较大,这在资本市场的表现中也反映明显。

沪深300指数在2010年一、二季度大幅下跌,从年初的3575点开始逐波下跌,到7月初最低跌至2462点,区间跌幅超过31%,是全球表现最差的股票市场之一。下半年由于经济稳步回升,市场又开始震荡上行,在四季度达到年初高点附近后,由于通胀快速上行,市场再度回落,沪深300指数全年下跌12.5%。

一季度,本基金对市场整体走向判断比较正确,年初低配了保险、证券、有色、地产、煤炭等强周期性行业,减少了一月份这些行业下跌对净值的影响。同时,出于看好内需消费方向,本基金在医药、零售、电子、家电、航空等行业增加了配置,并通过精选个股获取了较好的投资收益。但由于对于系统性风险的认识不足,因此一直保持了较高仓位运作,在二季度末的恐慌性下跌中,基金业绩表现不好。

下半年,我国宏观经济运行触低回升态势逐步显现,8、9两个月的PMI指标稳步回升,经济增速开始走出低谷,为市场走好奠定了基础。但同时,前期美国量化宽松滞后效应开始体现,以农产品为首的物价开始上涨,通胀压力日益明显,货币政策开始逐步回收,利率与准备金工具开始动用,资本市场上行压力较大。

本基金在下半年保持了核心持仓的稳定,依然遵循"蜻蜓构"的逻辑,重点配置在大民生大消费方向,坚定持有了医药、商业零售、食品饮料、家电、新兴产业等行业,获取了较好收益。另外,由于看到实体经济的逐步转暖及通胀压力渐显,本基金在增持了工程机械、煤炭、有色、建材、农业等行业适当增加了配置,获得了一定的效果。

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1.5013元,本报告期份额净值增长率为20.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了2009年的经济危机及2010年的快速复苏以后,全球经济格局发生了巨大变化,全球经济再平衡将是一个持续而漫长过程。以美国为首的发达经济体依靠过度消费维持增长的模式将很难重演。在这样的国际大环境下,中国的出口导向型经济必然转向以内需为主的经济发展模式。同时,高依存度的外向型经济对于一个超10亿人口的大国来说,本身就是不安全和不合理的。

中国过去几年经济高速增长除了出口的拉动外,房地产行业贡献巨大,是名符其实的支柱产业。但在目前的发展阶段阶段下,原有的房地产粗放的发展模式已经积累了相当的金融风险;同时,不断上涨的房价不但造成了社会资源的严重错配,同时也产生了更多的社会问题。因此,中国政府在房地产行业方面出台了一系列的政策来抑制房价,在经济转型的大背景下,房地产行业地位逐步下降已经成为政策调整的必然。

展望未来,外需走弱、劳动力成本上升、环境资源约束等因素要求我们转变原有的经济增长模式,这就意味着,以往出口与投资高增长局面将会逐步改变,而内需、民生、消费,将成为未来较长时间内最重要的增长方式。未来市场重点关注的方向依然要顺应调结构的产业转型趋势,与未来中国新的经济增长动力产业站在一起。

预计2011年,我国经济运行继续回升的态势将会延续,对"二次探底"的担忧将会基本消除。但同时也需要看到,海外经济复苏乏力,部分重要经济体存在继续量化宽松的倾向。因此,充裕的流动性带来的通胀压力迫存在进一步攀升的压力,农产品和大宗商品价格也存在阶段性上涨的动力。通胀,将是未来资本市场较长时期需要高度关注的问题。

基于上述宏观经济形势的判断,以及目前较便宜的整体市场估值,预计2011年国内股票市场将延续震荡盘升的格局,市场底部应该逐步抬高。在行业板块上,2011年的表现可能会更加均衡,市场延续2010年两级分化的概率不大。以金融、地产为代表传统大盘蓝筹股,整体估值非常便宜,虽然存在政策上的压制,但考虑到整体板块依然不错的业绩增长,其投资价值已经凸现。新兴产业与大消费板块,代表了未来产业转型的调整方向,依然是孕育大牛股的温床。但由于整体板块估值较高,需要投资者更深入的研究来发掘真正能够长期持续增长的优秀公司。

本基金管理人在下阶段将适当均衡配置,增加低估值的大盘蓝筹板块的配置;同时继续加强消费与新兴产业的个股研究,寻找高成长性的优质公司长期持有。

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分管估值委员会,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5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1,140,000,000.00元(每十份基金份额分红3.80元)。本报告期末本基金可供分配收益为704,963,840.67元,本基金已于2011年3月1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2.20元,符合基金合同规定的分红比例。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管景福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《景福证券投资基金基金合同》、《景福证券投资基金托管协议》的约定,对景福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景福证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支、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,景福证券投资基金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景福证券投资基金年度报告中的财务指标、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:景福证券投资基金
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	62,121,495.90	31,196,410.76
结算备付金	7,721,375.39	15,812,467.56
存出保证金	2,019,677.84	4,046,895.58
交易性金融资产	4,431,489,169.00	4,793,651,609.11
其中:股票投资	3,522,386,441.80	3,814,887,097.51
基金投资	-	-
债券投资	909,102,727.20	978,764,511.60
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	15,903,991.40	31,082,679.81
应收利息	15,918,989.32	16,423,979.12
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,535,174,698.85	4,892,214,041.94
负债和所有者权益	**本期期末 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	10,764,955.51	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,801,502.31	5,023,383.69
应付托管费	960,300.48	1,004,676.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,810,026.59	9,294,254.04
应交税费	1,698,624.04	1,698,624.04
应付利息	-	-
应付利润	6,000,000.00	7,425,000.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,351,708.38	1,351,708.38
负债合计	31,387,117.31	25,797,646.89
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	1,503,787,581.54	1,866,416,395.05
所有者权益合计	4,503,787,581.54	4,866,416,395.05
负债和所有者权益总计	4,535,174,698.85	4,892,214,041.94

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.5013元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 利润表
会计主体:景福证券投资基金
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	873,742,969.74	1,972,474,789.86
1.利息收入	29,821,601.33	29,798,018.84
其中:存款利息收入	1,282,781.43	1,054,686.00
债券利息收入	28,538,819.9	28,743,332.84
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)	647,448,258.6	986,520,718.29
其中:股票投资收益	630,681,629.21	939,162,361.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,078,893.99	24,992,828.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,687,735.4	22,365,527.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	196,452,869.68	956,155,185.14
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	20,240.13	867.59
减:二、费用	96,371,783.25	102,468,851.04
1.管理人报酬	51,982,500.36	51,246,776.86
2.托管费	10,396,500.05	10,249,355.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	27,748,172.96	38,859,093.02
5.利息支出	2,732,587.28	1,610,365.03
其中:卖出回购金融资产支出	2,732,587.28	1,610,365.03
6.其他费用	3,512,022.6	503,260.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	777,371,186.49	1,870,005,938.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	777,371,186.49	1,870,005,938.82

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:景福证券投资基金
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)	3,000,000,000.00	1,866,416,395.05	4,866,416,395.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	777,371,186.49	777,371,186.49
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-1,140,000,000.00	-1,140,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	1,503,787,581.54	4,503,787,581.54
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)	3,000,000,000.00	-3,589,543.77	2,996,410,456.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,870,005,938.82	1,870,005,938.82
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	3,000,000,000.00	1,866,416,395.05	4,866,416,395.05

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:王颖 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")	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金发起人、基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金发起人、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
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。广东证券作为本基金发起人的权利义务及持有的基金份额的继承机构尚待明确。

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	1,222,889,926.38	6.86	2,831,472,966.39	11.16

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	1,039,448.87	6.99	1,039,448.87	17.90
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	2,406,738.26	11.35	385,583.66	4.15

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。权证交易不计佣金。

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	51,982,500.36	51,246,776.86
其中:支付给销售机构的客户维护费	-	-

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1.25%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.25% / 当年天数。若由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%,超过部分不计提管理人报酬。

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	10,396,500.05	10,249,355.37

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

单位:人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	79,710,789.45	72,489,913.84	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	42,560,548.49	-	-	-	150,000,000.00	16,863.36

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(1999年12月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
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	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.25%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	5,815,209.00	0.19%	3,750,300.00	0.13%
广东证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

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	62,121,495.90	1,167,400.06	31,196,410.76	917,025.33

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

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

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金应付利润中应付关联方余额列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
广东证券	6,000,000.00	4,575,000.00
合计	6,000,000.00	4,575,000.00

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	2010/10/15	2011/10/13	非公开发行	30.00	33.75	4,000,000	120,000,000.00	135,000,000.00	-
601933	永辉超市	2010/12/09	2011/03/15	新股网下申购	23.98	31.24	108,825	2,609,623.50	3,399,693.00	-

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。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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	3,522,386,441.80	77.67
	其中:股票	3,522,386,441.80	77.67
2	固定收益投资	909,102,727.20	20.05
	其中:债券	909,102,727.20	20.05
	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	69,842,871.29	1.54
6	其他各项资产	33,842,658.56	0.75
7	合计	4,535,174,698.85	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票指数投资组合

8.2.1指数投资部分

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	80,097,276.60	1.78
C	制造业	1,446,988,057.34	32.13
C0	食品、饮料	486,453,214.84	10.80
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	44,449,263.40	0.99
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	580,398,986.60	12.89
C8	医药、生物制品	335,686,592.50	7.45
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	222,680,627.30	4.94
H	批发和零售贸易	39,300,000.