景宏证券投资基金

【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

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28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	大成景宏封闭
基金主代码	184691
交易代码	184691
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年5月4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	2,000,000,000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	1999年5月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金分别在资产配置、行业配置、个股选择三个层次上采取积极主动的策略进行投资。根据宏观经济状况和市场未来趋势进行资产配置;依据对行业景气的判断进行行业权重配置;在个股方面,选择治理结构完善、管理有方、信息透明、行业竞争力强、财务状况良好而且其内在价值被市场低估的上市公司进行投资。

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、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	376,447,123.38	568,910,518.73	211,990,020.18
本期利润	64,796,538.12	1,350,048,156.07	-2,918,701,558.30
加权平均基金份额本期利润	0.0324	0.6750	-1.4594
本期基金份额净值增长率	2.92%	60.60%	-49.00%
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	0.2131	0.3349	0.2298
期末基金资产净值	2,834,414,170.56	3,389,617,632.44	2,459,569,476.37
期末基金份额净值	1.4172	1.6948	1.2298

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。

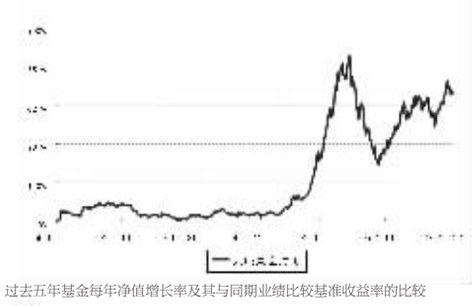
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

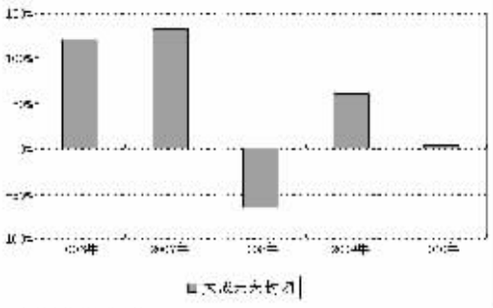
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.85%	2.62%	-	-	-	-
过去六个月	25.57%	2.46%	-	-	-	-
过去一年	2.92%	2.63%	-	-	-	-
过去三年	-15.71%	3.37%	-	-	-	-
过去五年	328.96%	3.47%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	464.62%	3.03%	-	-	-	-

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



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年	3.100	620,000,000.00	-	620,000,000.00	2009 年 度 收益分配
2009年	2.100	420,000,000.00	-	420,000,000.00	2008 年 度 收益分配
2008年	8.000	1,600,000,000.00	-	1,600,000,000.00	2007 年 度 收益分配
合计	13.200	2,640,000,000.00	-	2,640,000,000.00	

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
袁青先生	本基金基金经理	2008年1月12日	2010年4月6日	10年	硕士。曾任江铃汽车股份公司产品开发部工程师、华源凯马股份公司投资部经理助理、平安证券综合研究所研究员。2005年加入大成基金管理有限公司,历任投资部研究员、景宏证券投资基金基金经理助理、大成优选股票型证券投资基金基金经理助理。2010年2月2日起担任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国。
黄万青女士	本基金基金经理	2010年4月7日	--	12年	经济学硕士。1999年加入大成基金管理有限公司,先后任交易部交易员、债券基金经理助理、景福基金经理助理、固定收益小组股票型基金债券投资经理、大成价值增长基金基金经理助理、大成景阳领先基金基金经理助理。2010年4月7日开始担任景宏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》、《景宏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,景宏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

2010年A股市场整体表现为震荡下行,沪深300指数下跌12.5%,而同期中小板指数上涨28.4%,中小市值股票获得相对较好的回报。从行业板块看,医药、TMT、机械等在本年度领涨,而银行、地产、航运和钢铁等板块表现落后于沪深300指数。

本年度市场的下跌主要受政策调控的影响,如占市场权重较大的银行、地产两大板块在本年度受到政策紧缩的影响,估值水平不断下移,使得市场缺少整体投资机会,而有限的资金助推中小市值板块持续上涨,出现明显的局部牛市行情。

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1.4172元,本报告期份额净值增长率为2.92%。

4.5 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,我们分析2011年A股市场整体将会震荡向上,低估值的大盘蓝筹股有望迎来修复性反弹行情。

从宏观层面看,2011年国内外经济将继续保持较好的增长,企业盈利能力持续回升。2011年最大的问题是高通胀问题和高企的房价问题,我们分析2011年第1季度应该是全年政策最为收紧的时候,也应该是全年通胀较高时期。我们分析紧缩政策将逐步发挥作用,全年的通胀基本可控,政府也应该实现房价调控的目标。

从企业层面看,国内经济企稳迹象明显。近两个月的经济数据表明,宏观经济下滑的趋势已经被遏止,表现为PMI和工业增加值的持续上升,投资增速下滑的幅度低于预期,在严厉的房地产调控政策压力之下,房地产投资实际上也好于预期的。在市场整体估值较低和企业盈利好转的背景下,全年A股市场整体应该是向上的。但我们在谨慎乐观的同时也分析全年市场可能存在的风险,如政府可能在1季度会出台更加严厉的调控房地产或者流动性的政策,这些政策的出台可能会加大市场的波动。

资产配置方面,仓位上我们基本不作大的变动,尤其在市场处于相对低位,我们总体仓位将保持在略高于市场的平均水平,我们将投资重点放在行业配置和个股选择上。行业配置上,我们重点还是配置景气度向上的具有稳定增长的消费类行业和服务性行业,如医药、食品饮料、家电等行业。在看好稳定增长类板块的同时,围绕如下两条主线灵活配置,一是在通胀和外围市场资金宽松的背景下增加配置资源类板块、农业水产和白酒板块;二是人民币升值受益板块如航空等。此外,在政府调结构、节能减排的政策导向下,新能源新材料板块、技术创新类板块等值得我们去深入分析和挖掘有价值的投资标的。我们将通过前瞻性的研究去挖掘被低估的行业龙头以及成长性确定的个股。希望通过我们不懈的努力来回报本基金持有人的信任与厚爱。

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620,000,000.00元(每十份基金份额分红3.10元)。本报告期末本基金可供分配收益为426,186,543.82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1.95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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对景宏证券投资基金(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 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:景宏证券投资基金

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	18,619,195.83	53,424,108.93
结算备付金	6,975,767.11	11,417,913.41
存出保证金	388,549.12	1,922,087.91
交易性金融资产	2,814,543,626.83	3,364,328,619.47
其中:股票投资	2,233,447,098.83	2,681,827,325.47
基金投资	-	-
债券投资	581,096,528.00	682,501,294.00
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	8,453,110.36	-
应收利息	10,933,556.10	13,923,642.86
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,859,913,805.35	3,445,016,372.58
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	2,573,961.68	28,296,283.10
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,603,653.89	4,235,246.23
应付托管费	600,608.98	705,874.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,257,806.92	3,497,733.10
应交税费	1,173,603.32	1,173,603.32
应付利息	-	-
应付利润	12,840,000.00	17,040,000.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	450,000.00	450,000.00
负债合计	25,499,634.79	55,398,740.14
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	834,414,170.56	1,389,617,632.44
所有者权益合计	2,834,414,170.56	3,389,617,632.44
负债和所有者权益总计	2,859,913,805.35	3,445,016,372.58

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.4172元,基金份额总额2,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:景宏证券投资基金

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	135,795,584.64	1,424,830,458.95
1.利息收入	20,375,613.01	24,834,006.39
其中:存款利息收入	873,444.64	677,193.67
债券利息收入	19,502,168.37	24,156,812.72
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)	427,052,755.91	618,858,815.22
其中:股票投资收益	409,532,592.96	589,163,881.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,681,389.62	13,150,117.07
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,838,773.33	16,544,816.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-311,650,585.26	781,137,637.34
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	17,800.98	-
减:二、费用	70,999,046.52	74,782,302.88
1.管理人报酬	41,613,348.99	44,072,959.63
2.托管费	6,935,558.09	7,345,493.30
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	18,167,421.67	20,582,013.49
5.利息支出	1,953,607.59	1,058,099.87
其中:卖出回购金融资产支出	1,953,607.59	1,058,099.87
6.其他费用	2,329,110.18	1,723,736.59
三、利润总额	64,796,538.12	1,350,048,156.07
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	64,796,538.12	1,350,048,156.07

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景宏证券投资基金

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)	2,000,000,000.00	1,389,617,632.44	3,389,617,632.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,796,538.12	64,796,538.12
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)	-	-620,000,000.00	-620,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	834,414,170.56	2,834,414,170.56
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)	2,000,000,000.00	459,569,476.37	2,459,569,476.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,350,048,156.07	1,350,048,156.07
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)	-	-420,000,000.00	-420,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	1,389,617,632.44	3,389,617,632.44

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")	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司("中国银行")	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
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金发起人、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
大鹏证券有限责任公司("大鹏证券")	基金发起人

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. 深圳市中级人民法院于2005年1月24日裁定大鹏证券破产,大鹏证券作为本基金发起人的权利义务及持有的发起人基金份额非流通部分的继承机构尚待明确。

3. 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	1,130,138,002.28	9.62%	1,418,152,219.72	10.64%

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	918,246.79	9.36%	-	-
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	1,152,260.24	10.32%	-	-

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。

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	41,613,348.99	44,072,959.63
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1.5%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。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	6,935,558.09	7,345,493.30

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。

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
中国银行	21,041,865.61	93,198,350.00	-	-	-	-
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
中国银行	-	-	-	-	-	-

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5月4日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
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	12,000,000.00	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.60%	0.60%

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	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
大鹏证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
广东证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%

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
中国银行	18,619,195.83	796,265.00	53,424,108.93	603,856.23

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。

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。

7.4.3.7 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	12,840,000.00	10,980,000.00
大鹏证券	-	6,060,000.00
合计	12,840,000.00	17,040,000.00

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
601933	永辉超市	10/12/09	11/03/15	新股网下申购	23.98	31.24	98,931	2,372,365.38	3,090,604.44	-

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。

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	2,233,447,098.83	78.09
	其中:股票	2,233,447,098.83	78.09
2	固定收益投资	581,096,528.00	20.32
	其中:债券	581,096,528.00	20.32
	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	25,594,962.94	0.89
6	其他各项资产	19,775,215.58	0.69
7	合计	2,859,913,805.35	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	-	0.00
B	采掘业	381,871,324.10	13.47
C	制造业	1,404,163,499.58	49.54
C0	食品、饮料	544,741,660.74	19.22
C1	纺织、服装、皮毛	62,709,642.16	2.21
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	17,830,000.00	0.63
C6	金属、非金属	109,531,282.40	3.86
C7	机械、设备、仪表	373,891,410.03	13.19
C8	医药、生物制品	295,459,504.25	10.42
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	13,755,000.00	0.49
H	批发和零售贸易	3,090,604.44	0.11
I	金融、保险业	286,863,980.59	10.12
J	房地产业	143,702,690.12	5.07
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	2,233,447,098.83	78.80

8.3 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	600276	恒瑞医药	3,543,695	211,062,474.20	7.45
2	000527	美的电器	10,487,364	182,480,133.60	6.44
3	000568	泸州老窖	3,286,609	134,422,308.10	4.74
4	600132	重庆啤酒	2,300,000	127,489,000.00	4.50
5	600519	贵州茅台	661,149	121,598,524.08	4.29
6	601699	潞安环能	1,957,106	116,721,801.84	4.12
7	002142	宁波银行	7,746,029	96,050,759.60	3.39
8	002329	皇氏乳业	1,865,176	91,971,828.56	3.24
9	600348	国阳新能	2,907,974	83,400,694.32	2.94
10	601169	北京银行	7,040,271	80,540,700.24	2.84

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)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600036	招商银行	264,894,615.55	7.81
2	601318	中国平安	242,093,689.71	7.14
3	600348	国阳新能	231,008,735.44	6.82
4	002142	宁波银行	226,713,136.61	6.69
5	601169	北京银行	220,112,263.47	6.49
6	600048	保利地产	158,803,652.33	4.69
7	000568	泸州老窖	148,054,646.99	4.37
8	000527	美的电器	147,255,319.16	4.34
9	601166	兴业银行	139,995,519.15	4.