大成标普500等权重指数证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

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
送出日期:2012年8月25日

§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2012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1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500 等权重指数QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23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	131,452,444.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-

2.5 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 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	604,736.69
本期利润	9,880,152.83
加权平均基金份额本期利润	0.0702
本期基金份额净值增长率	7.13%
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	-0.0538
期末基金资产净值	124,374,248.00
期末基金份额净值	0.946

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。

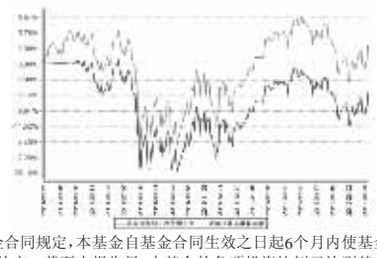
3.2 净值表现

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	3.39%	1.35%	3.89%	1.46%	-0.50%	-0.11%
过去三个月	-3.67%	1.03%	-4.04%	1.14%	0.37%	-0.11%
过去六个月	7.13%	0.92%	8.08%	0.96%	-0.95%	-0.04%
过去一年	-4.06%	1.61%	-0.12%	1.66%	-3.94%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-5.40%	1.46%	3.60%	1.52%	-9.00%	-0.06%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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、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。截至本报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	8年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部,任研究员;2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部,任高级研究员;2005年9月加入大成基金管理有限公司,历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日开始担任大成标普500等权重指数型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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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》、《大成标普500等权重指数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,大成标普500等权重指数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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年上半年,国际宏观经济及金融领域出现了纷繁多变的局势。

在本年第一季度,欧洲主权债务危机有所缓解。一方面,希腊、西班牙及意大利等多个陷入财政困境的国家均采取了程度各异的财政紧缩政策以恢复市场信心;另一方面,以欧洲央行为主导的众多国际金融组织采取了多项救助政策,尤其是欧洲央行的LTRO政策卓有成效。因此,意大利、西班牙等国的政府债券收益率水平出现显著下降,欧洲主权债务危机暂时有所缓解。

同期,美国的宏观经济持续走强,主要特征包括了劳动力市场逐步改善、住宅市场初步回暖、个人收入及消费持续增长。在此多重因素的刺激下,美国一季度的各项宏观经济指标都保持在较佳的水平上。

但是,进入到第二季度后,欧洲主权债务危机又一次加剧。希腊动荡的政治局势曾经导致金融市场一度认为其退出欧元区的概率较大;同期西班牙多家大型银行出现危机,并正式提出援助申请,导致意大利、西班牙的国债收益率创出欧债危机以来的新高。欧洲金融体系的动荡严重影响到了欧洲的实体经济,欧洲经济出现快速萎缩的局面。

在第二季度,受到欧洲经济局势的影响,美国经济增长的步伐也开始放缓。耐用品订单出现减少,劳动力市场持续改善的局势也得以中止。但是,美国的经济状况仍然是大型发达经济体中最好的之一,美国的经济仍然处于正增长之中,尚未出现经济衰退的征兆。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨8.08%,美元兑人民币中间价上涨0.38%,本基金净值上涨7.13%,低于经汇率调整后的目标指数1.36%。在本报告期,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.19%,日均偏差绝对值为0.06%,均显著低于本基金合同中的目标值。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末, 本基金份额资产净值为0.946元, 本报告期基金份额净值增长率为7.13%同期业绩比较基准收益率为8.08%,低于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

欧债危机的前景仍然扑朔迷离。虽然今年六月底的欧盟峰会迈出了创建运行更完善欧元区所需的治理结构的漫漫长路上的重要一步,并承诺了对西班牙银行体系的救助,但是,西班牙及意大利的状况持续恶化,致使欧债危机的前景尚不明朗。

美国的经济数据显示美国的增长速度已然放缓,但是除了美国各级政府之外的实体经济各部门的资产负债表都比较健康,而且美国的房地产市场预计已经有触底回升的迹象。因此,在欧债危机可控的情况下,美国经济仍有望实现正增长。

同时,美联储依然对刺激经济增长保持积极的态度,一旦美国的经济增长出现了较大的潜在风险,美联储有极大的可能性会推出新一轮量化宽松政策以刺激经济增长。

本基金为被动型指数基金,其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念,继续深入研究更为高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法,以期更好的跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 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。

4.8 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")在对大成标普500等权重指数证券投资基金 (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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

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	8,218,189.05	8,206,414.51
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	117,101,196.45	125,728,789.60
其中:股票投资	117,101,196.45	125,728,789.60
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	-	363,326.40
应收利息	213.34	746.12
应收股利	146,186.21	191,040.70
应收申购款	49,489.77	156,946.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	125,515,274.82	134,647,263.61
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	347,693.92	-
应付赎回款	456,860.96	1,485,945.78
应付管理人报酬	99,131.49	113,815.16
应付托管费	24,782.87	28,453.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	212,557.58	224,431.88
负债合计	1,141,026.82	1,852,646.60
所有者权益:		
实收基金	131,452,444.92	150,455,310.00
未分配利润	-7,078,196.92	-17,660,692.99
所有者权益合计	124,374,248.00	132,794,617.01
负债和所有者权益总计	125,515,274.82	134,647,263.61

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.946元,基金份额总额131,452,444.92份。

6.2 利润表

公告主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

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3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日
一、收入	11,002,136.23	279,213.74
1.利息收入	13,490.66	2,337,310.01
其中:存款利息收入	13,451.52	2,337,310.01
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	39.14	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,690,451.38	-27,764.91
其中:股票投资收益	597,540.40	-457,355.64
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	1,092,910.98	429,590.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9,275,416.14	-2,620,648.87
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-28,317.45	-228,945.63
5.其他收入(损失以"-"号填列)	51,095.50	819,263.14
减:二、费用	1,121,983.40	1,541,884.11
1.管理人报酬	662,407.76	1,090,291.61
2.托管费	165,601.93	272,572.88
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	14,703.30	63,240.02
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	279,270.41	115,779.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	9,880,152.83	-1,262,670.37
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	9,880,152.83	-1,262,670.37

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成标普500等权重指数证券投资基金

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)	150,455,310.00	-17,660,692.99	132,794,617.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,880,152.83	9,880,152.83
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)	-19,002,865.08	702,343.24	-18,300,521.84
其中:1.基金申购款	27,688,859.66	-1,084,714.53	26,604,145.13
2.基金赎回款	-46,691,724.74	1,787,057.77	-44,904,666.97
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)	131,452,444.92	-7,078,196.92	124,374,248.00
项目	**上年度可比期间 2011年3月23(基金合同生效日)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)	822,754,222.26	-	822,754,222.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,262,670.37	-1,262,670.37
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)	-651,809,447.83	-1,111,219.43	-652,920,667.26
其中:1.基金申购款	2,517,817.46	-28,851.04	2,488,966.42
2.基金赎回款	-654,327,265.29	-1,082,368.39	-655,409,633.68
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)	170,944,774.43	-2,373,889.80	168,570,884.63

注: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("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
中国银行(香港)股份有限公司("中银香港")	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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

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

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.3.1 关联方报酬

6.4.3.1.1 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3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	662,407.76	1,090,291.61
其中:支付销售机构的客户维护费	278,974.84	424,359.90

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1.0%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 1.0% / 当年天数。

6.4.3.1.2 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3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	165,601.93	272,572.88

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。

6.4.3.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

6.4.3.4 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年3月23日(基金合同生效日)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
中银香港	6,553,575.62	-	2,217,429.02	-
中国银行	1,664,613.43	13,451.52	13,986,083.35	2,337,310.01

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管,按银行同业利率计息。

6.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.3.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.4 利润分配情况

本报告期及上年度可比期间内本基金无利润分配。

6.4.5 期末 (2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

§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	117,101,196.45	93.30
	其中:普通股票	117,101,196.45	93.30
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	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
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	8,218,189.05	6.55
8	其他各项资产	195,889.32	0.16
9	合计	125,515,274.82	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
美国	117,101,196.45	94.15
合计	117,101,196.45	94.15

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比列(%)
金融	19,179,294.25	15.42
消费者非必需品	18,787,837.19	15.11
信息技术	16,241,334.04	13.06
工业	14,096,478.75	11.33
医疗保健	12,345,640.38	9.93
能源	10,375,368.43	8.34
消费者常用品	9,731,922.98	7.82
公用事业	7,447,247.50	5.99
基础材料	6,986,121.00	5.62
电信服务	1,909,951.93	1.54
合计	117,101,196.45	94.15

注:以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比列(%)
1	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	1,873	320,567.31	0.26
2	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	1,959	276,183.78	0.22
3	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	1,098	273,622.76	0.22
4	Pulte Group Inc	Pulte集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	4,033	272,939.04	0.22
5	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	960	272,749.93	0.22
6	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	1,341	270,820.39	0.22
7	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	US	2,838	270,328.00	0.22
8	Lennar Corp	Lennar公司	LEN UN	纽约交易所	US	1,364	266,665.63	0.21
9	Vulcan Materials Co	Vulcan材料公司	VMC UN	纽约交易所	US	1,061	266,482.65	0.21
10	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences公司	EW UN	纽约交易所	US	406	265,265.04	0.21

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。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Fossil Inc	FOSL UQ	313,282.67	0.24
2	WPX Energy Inc.	WPX UN	274,059.99	0.21
3	Crown Castle Intl Corp	CCI UN	265,235.27	0.20
4	Phillips 66	PSX UN	231,867.09	0.17
5	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	229,242.08	0.17
6	Exelon Corp	EXC UN	224,175.79	0.17
7	Monster Beverage Corp	MNST UQ	215,806.49	0.16
8	First Solar Inc	FSLR UQ	211,423.67	0.16
9	Lam Research Corp	LRCX UQ	184,706.05	0.14
10	Alpha Natural Resources	ANR UN	166,058.62	0.13
11	Kinder Morgan Inc	KMI UN	156,436.69	0.12
12	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	117,744.54	0.09
13	NetFlix Inc	NFLX UQ	106,109.59	0.08
14	Allegheny Technologies Inc	ATI UN	105,040.60	0.08
15	Apollo Group Inc	APOL UQ	104,064.88	0.08
16	Electronic Arts	EA UQ	101,168.08	0.08
17	GENWORTH FINANCIAL INC	GNW UN	98,163.18	0.07
18	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	FTR UQ	93,765.44	0.07
19	PEABODY ENERGY CORP	BTU UN	93,201.17	0.07
20	SEARS HLDGS CORP	SHLD UQ	89,074.14	0.07

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。

7.5.2 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	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	MHS UN	281,083.00	0.21
2	Sara Lee Corp	SLE UN	269,033.32	0.20
3	Motorola Mobility Holdings, Inc	MMI UN	267,272.33	0.20
4	Supervalu Inc	SVU UN	259,808.53	0.20
5	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	249,307.49	0.19
6	NOVELLUS SYSTEMS INC	NVLS UQ	242,907.85	0.18
7	CONSTELLATION ENERGY GROUP INC	CEG UN	239,753.07	0.18
8	EL PASO CORP	EP UN	221,832.71	0.17
9	Expedia	EXPE UQ	213,962.08	0.16
10	Exelon Corp	EXC UN	197,280.58	0.15
11	Sears Holdings Corp	SHLD UQ	191,994.18	0.14
12	Regions Financial Corp	RF UN	177,879.03	0.13
13	Pulte Group Inc	PHM UN	176,546.06	0.13
14	SUNOCO INC	SUN UN	173,836.00	0.13
15	Bank of America Corp	BAC UN	158,738.80	0.12
16	NetFlix Inc	NFLX UQ	156,575.92	0.12
17	Whirlpool Corp	WHR UN	150,807.48	0.11
18	Sherwin-Williams Co	SHW UN	150,422.25	0