

大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 半年度报告摘要

复制行情, 然而又大幅调整。在行业方面, 有色金属、房地产、非银行金融等行业领涨大幅。上半年A股市场深证300指数上涨4.94%, 本基金标的指数深证成长40指数上涨5.65%, 涨幅高于大盘。

上半年, 根据基金合同约定, 投资于目标ETF份额的资产不低于基金资产净值的90%, 通过完全复制法, 使联接基金目标ETF的走势基本一致。本半年度跟踪误差2.12%, 日均跟踪误差0.06%, 各项操作与目标符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现: 截止本报告期末, 本基金份额资产净值为0.788元, 本报告期基金份额净值增长率为5.63%, 同期业绩比较收益率为5.49%, 高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望: 宏观经济正在处于经济周期的末段, 增速下降已经成为投资者的共识, 企业盈利压力加大, 上市公司业绩将受到直接的影响, 即将公布的中报预计有所反映。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明: 本基金管理人将基金估值业务外包给估值委员会, 估值委员会由基金管理人主要业务部门负责人和估值程序制定、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、委托投资部等部门组成。

4.7 托管人对报告期内基金投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况的说明: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

4.8 报告期内基金管理人履行信息披露义务的说明: 本基金管理人认为, 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。

4.9 报告期内基金管理人履行信息披露义务的说明: 本基金管理人认为, 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。

5.1 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.2 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.3 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.4 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.5 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.6 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.7 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.8 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.9 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.10 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.11 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.12 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.13 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.14 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.15 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.16 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.17 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.18 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.19 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.20 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.21 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.22 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.23 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.24 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.25 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.26 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.27 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.28 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.29 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

5.30 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况: 大成基金管理人对大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、净值变动情况、是否符合基金合同约定、基金资产净值增长情况进行了认真、独立的会计核算和监督。

Table with columns: 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(%)

注: 卖出包括二级市场主动的卖出、被动卖出、赎回、要约收购、发行人回购及行权等获得的股票, 卖出金额按成交金额或成交均价乘以成交量计算, 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

7.5 期末按股票品种分类的股票投资组合

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

Table with columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

7.10 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.10.1 本基金投资组合中, 有1名证券的发行人主体未出现本期被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

7.10.2 本基金投资组合前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票

7.10.3 期末其他各项资产净值

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.10.5 本基金投资组合中, 有1名证券的发行人主体未出现本期被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

7.10.6 本基金投资组合前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票

7.10.7 期末其他各项资产净值

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额

8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

9 开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 基金份额(份), 占基金总份额比例

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人、基金托管银行的重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

10.6 基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票交易及佣金支付情况

Table with columns: 券商名称, 交易数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

注: 1. 本报告期末本基金未退市, 未新增交易单元。

2. 租用券商专用交易单元的选择标准和程序: 根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定, 本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括: 1. 财务状况良好, 最近一年无重大违规行为;

2. 经营行为规范, 内部控制健全, 能满足各投资组合运作的保密性要求;

3. 研究实力较强, 能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;

4. 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件, 有足够的交易和清算能力, 满足各投资组合证券交易的需要;

5. 能提供投资组合运作、管理所需的其他证券服务;

6. 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件

租用证券公司交易单元的程序: 首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成 券商服务评价表, 然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with columns: 券商名称, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期基金资产净值比例

资产: 银行存款 81,177,820.18

货币资金 467,460.40

交易性金融资产 1,473,225,365.28

其中: 股票投资 17,892,865.28

债券投资 1,455,332,500.00

资产支持证券投资 1,451,258,000.00

衍生金融资产 1,555,450,910.81

买入返售金融资产 1,577,590,974.58

应收证券清算款 694,895.31

应收利息 15,170.47

应收股利 19,234.75

其他资产 32,554.88

资产总计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益 1,577,590,974.58

负债: 短期借款 1,172,823.81

交易性金融负债 1,368,475.01

衍生金融负债 1,172,823.81

卖出回购金融资产款 1,172,823.81

应付证券清算款 694,895.31

应付利息 15,170.47

应付股利 19,234.75

其他负债 32,554.88

所有者权益 1,555,450,910.81

实收资本 1,555,450,910.81

未分配利润 -417,665,430.63

所有者权益合计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益总计 1,577,590,974.58

注: 报告期末(2012年6月30日), 基金份额净值0.788元, 基金份额总额1,971,608,344.91份。

6.2 利润分配

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期: 2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期

一、期初所有者权益(基金净值) 2,113,710,448.71

1. 收入 92,407,028.25

1.1 利息收入 359,237.62

其中: 存款利息收入 359,237.62

债券利息收入 1,455,332,500.00

资产支持证券投资利息收入 1,451,258,000.00

买入返售金融资产收入 1,577,590,974.58

其他利息收入 1,577,590,974.58

2. 投资收益(损失以“-”填列) -33,013,982.67

其中: 股票投资收益 -375,540.90

基金投资收益 -29,734,645.00

债券投资收益 21,408.51

资产支持证券投资 1,451,258,000.00

衍生金融资产 1,555,450,910.81

买入返售金融资产 1,577,590,974.58

应收证券清算款 694,895.31

应收利息 15,170.47

应收股利 19,234.75

其他资产 32,554.88

资产总计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益 1,577,590,974.58

负债: 短期借款 1,172,823.81

交易性金融负债 1,368,475.01

衍生金融负债 1,172,823.81

卖出回购金融资产款 1,172,823.81

应付证券清算款 694,895.31

应付利息 15,170.47

应付股利 19,234.75

其他负债 32,554.88

所有者权益 1,555,450,910.81

实收资本 1,555,450,910.81

未分配利润 -417,665,430.63

所有者权益合计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益总计 1,577,590,974.58

注: 报告期末(2012年6月30日), 基金份额净值0.788元, 基金份额总额1,971,608,344.91份。

6.2 利润分配

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期: 2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期

一、期初所有者权益(基金净值) 2,113,710,448.71

1. 收入 92,407,028.25

1.1 利息收入 359,237.62

其中: 存款利息收入 359,237.62

债券利息收入 1,455,332,500.00

资产支持证券投资利息收入 1,451,258,000.00

买入返售金融资产收入 1,577,590,974.58

其他利息收入 1,577,590,974.58

2. 投资收益(损失以“-”填列) -33,013,982.67

其中: 股票投资收益 -375,540.90

基金投资收益 -29,734,645.00

债券投资收益 21,408.51

资产支持证券投资 1,451,258,000.00

衍生金融资产 1,555,450,910.81

买入返售金融资产 1,577,590,974.58

应收证券清算款 694,895.31

应收利息 15,170.47

应收股利 19,234.75

其他资产 32,554.88

资产总计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益 1,577,590,974.58

负债: 短期借款 1,172,823.81

交易性金融负债 1,368,475.01

衍生金融负债 1,172,823.81

卖出回购金融资产款 1,172,823.81

应付证券清算款 694,895.31

应付利息 15,170.47

应付股利 19,234.75

其他负债 32,554.88

所有者权益 1,555,450,910.81

实收资本 1,555,450,910.81

未分配利润 -417,665,430.63

所有者权益合计 1,555,450,910.81

负债和所有者权益总计 1,577,590,974.58

注: 报告期末(2012年6月30日), 基金份额净值0.788元, 基金份额总额1,971,608,344.91份。

6.2 利润分配

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期: 2012年1月1日至2012年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期

一、期初所有者权益(基金净值) 2,113,710,448.71

1. 收入 92,407,028.25

1.1 利息收入 359,237.62

其中: 存款利息收入 359,237.62

债券利息收入 1,455,332,500.00

资产支持证券投资利息收入 1,451,258,000.00

买入返售金融资产收入 1,577,590,974.58

其他利息收入 1,577,590,974.58

2. 投资收益(损失以“-”填列) -33,013,982.67

其中: 股票投资收益 -375,540.90

基金投资收益 -29,734,645.00

债券投资收益 21,408.51