

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:2013年1月1日至2013年12月31日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会、监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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年3月25日复核了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、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人的过往绩效并不代表其未来表现。投资人选择本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要、基金年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期财务数据已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者请查阅注释。

本报告期:2013年01月01日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 大成沪深300指数

基金代码 519300

前缀交易代码 519300

后缀交易代码 519300

基金运作方式 约定开放式

基金成立日 2006年4月6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

报告期末基金总资产 5,874,017,400.92元

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

通过严格的投票约束和数量化风险管理手段，实现指数投资目标和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

本基金采用指数化投资策略。原则上，股票投资组合的构建将按照标的指数成份股及其权重来制定，复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

业绩比较基准 沪深300指数

本基金为指数基金，是风险中等，获得证券市场平均收益率的产品。

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 中国农业银行股份有限公司

姓名 郑鹏 李芳菲

信息披露负责人 联系电话 0755-83388888 010-66006009

电子邮箱 dupeng@fund.com.cn lfanglei@abcchina.com

客户服务电话 4008888558 95599

传真 0755-83195988 010-63201816

2.4 信息披露方式

基金年度报告的管理人互联网网址 http://www.dcfund.com.cn

深圳市福田区深南大道7008号招银大厦32层大成基

基金年度报告备置地点 北京市西城区复兴门内大街1号中国人寿金融中心东座19层

中国农业银行营业部

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 年度间数据和指标 2013年末 2012年末 2011年末

本期已实现收益 -356,732,659.04 -339,704,727.24 -100,768,369.85

本期利润 -202,152,150.38 462,384,792.32 -1,633,836,726.57

加权平均基金份额本期利润 -0.0308 0.0628 -0.0246

本期基金份额净值增长率 -5.31% 8.49% -23.77%

3.1.2 年度数据指标

项目 2013年末 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 -0.2183 -0.2795

期末基金资产净值 4,338,657,726.90 5,661,804,921.69 5,449,890,315.85

期末基金份额净值 0.7868 0.7817 0.7205

注:1.本基金管理人根据《基金合同》规定，本基金的初申购合同期为6个月。截至本报告日，本基金的各项投资比例已达

到本基金合同第二条之(六)规定的各项比例限制。

3.2 过去五年基金每年净值增长率及与同期比较基准收益率的比较

数据来源:基金定期报告，基金净值增长率=基金年度收益/基金年初净资产。

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 业绩比较基准长 标准差(%) 现比基 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.34% 1.03% -3.28% 1.12% -0.06% -0.09%

过去六个月 6.15% 1.20% 5.88% 0.27% -0.09%

过去一年 -5.31% 1.29% -7.65% 1.39% 2.14% -0.10%

过去三年 -21.86% 1.24% -25.52% 1.32% 3.60% -0.08%

过去五年 29.71% 1.46% 28.18% 1.55% 1.33% -0.09%

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

3.2.2 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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理的情况

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是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，是经中国证监会批准设立的全国性基金管理公司之一，注册资本为人民币1亿元人民币，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(49%)、广东证券股份有限公司(24%)、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2013年12月31日，本基金持有人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《基金法》及《基金合同》的规定以及《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》，《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》约定对本基金资产实行封闭运作，投资者在认购本基金后，基金资产即进入封闭状态，基金持有人不得赎回或转换，基金持有人的资产净值将随基金资产净值的变化而变化。

4.1.2 基金经理的管理经验

基金经理:郑鹏先生，经济学硕士，2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。

2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品经理、高级产品经理、基金经理助理、基金管理助理、基金经理，基金经理。2011年3月1日至2012年2月18日担任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成景阳量化股票型证券投资基金、大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2012年1月1日至2012年2月18日担任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2012年3月1日至2013年1月24日担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年1月24日起担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理；2013年2月17日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年3月1日至2013年12月31日担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理；2013年4月12日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年5月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年6月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年7月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年8月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年9月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年10月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年11月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年12月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理。

4.1.3 基金经理助理简介

姓名 职务 任期从 业年限 任职日期 离任日期

苏秉毅先生 基金基金经理 2013年1月1日 - 9年 经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。

2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品经理、高级产品经理、基金经理助理、基金管理助理、基金经理，基金经理。2011年3月1日至2012年2月18日担任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2012年1月1日至2012年2月18日担任大成景阳领先混合型证券投资基金、大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2012年3月1日至2013年1月24日担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年1月24日起担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理；2013年2月17日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年3月1日至2013年12月31日担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理；2013年4月12日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年5月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年6月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年7月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年8月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年9月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年10月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年11月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理；2013年12月10日起担任大成景阳量化股票型证券投资基金基金经理。

张坤女士 基金基金经理助理 3年

经济学硕士，2010年4月加入大成基金管理有限公司从事研究工作，现任固定收益投资部基金经理，具有基金从业资格。国籍:中国。

4.2 管理人对宏观经济的分析

4.2.1 对宏观经济的分析

4.2.2 对证券市场的分析

4.2.3 对行业及上市公司的分析

4.2.4 对股票的投资策略

4.2.5 对债券的投资策略

4.2.6 对货币市场的分析

4.2.7 对衍生品的投资策略

4.2.8 对其他投资品种的分析

4.2.9 对宏观经济的展望

4.3 管理人对基金未来业绩的展望

4.4 管理人对基金估值方法的说明

4.5 管理人对基金费用的说明

4.6 管理人对基金收益的说明

4.7 管理人对基金的市场营销与推广的说明

4.8 管理人对基金的风险揭示

4.9 管理人对基金的客户服务

4.10 管理人对基金的限售安排

4.11 管理人对基金的流动性安排

4.12 管理人对基金的估值政策和程序

4.13 管理人对基金的费用计提方法

4.14 管理人对基金的收益分配政策

4.15 管理人对基金的客户服务和联系方式

4.16 管理人对基金的其他重要事项

4.17 管理人对基金的持续督导

4.18 管理人对基金的其他重要事项

4.19 管理人对基金的其他重要事项

4.20 管理人对基金的其他重要事项

4.21 管理人对基金的其他重要事项

4.22 管理人对基金的其他重要事项

4.23 管理人对基金的其他重要事项

4.24 管理人对基金的其他重要事项

4.25 管理人对基金的其他重要事项

4.26 管理人对基金的其他重要事项

4.27 管理人对基金的其他重要事项

4.28 管理人对基金的其他重要事项

4.29 管理人对基金的其他重要事项

4.30 管理人对基金的其他重要事项

4.31 管理人对基金的其他重要事项

4.32 管理人对基金的其他重要事项

4.33 管理人对基金的其他重要事项

4.34 管理人对基金的其他重要事项

4.35 管理人对基金的其他重要事项

4.36 管理人对基金的其他重要事项

4.37 管理人对基金的其他重要事项

4.38 管理人对基金的其他重要事项

4.39 管理人对基金的其他重要事项

4.40 管理人对基金的其他重要事项

4.41 管理人对基金的其他重要事项

4.42 管理人对基金的其他重要事项

4.43 管理人对基金的其他重要事项

4.44 管理人对基金的其他重要事项

4.45 管理人对基金的其他重要事项

4.46 管理人对基金的其他重要事项

4.47 管理人对基金的其他重要事项

4.48 管理人对基金的其他重要事项

4.49 管理人对基金的其他重要事项

4.50 管理人对基金的其他重要事项

4.51 管理人对基金的其他重要事项

4.52 管理人对基金的其他重要事项

4.53 管理人对基金的其他重要事项

4.54 管理人对基金的其他重要事项

4.55 管理人对基金的其他重要事项

4.56 管理人对基金的其他重要事项

4.57 管理人对基金的其他重要事项

4.58 管理人对基金的其他重要事项