

DISCLOSURE  
信息披露

## 大成沪深300指数证券投资基金

## 2008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:2009年3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确认，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2009年3月25日复核了本基金中的财务指标、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。

本年度报告摘要自年度报告正式公告,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	大成300A
交易代码	519300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月6日

报告期末基金份额总额

7,397,235,977.87份

## § 2.1 基金基本情况

基金简称	大成300A
交易代码	519300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月6日

报告期末基金份额总额

7,397,235,977.87份

## § 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度跟踪误差的最小化。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%,跟踪误差不超过4%。	
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建将按照指标的成份股组成及其权重来拟合,指数组成及其权重的变动而进行相应调整。	
业绩比较基准	深证300指数	
风险收益特征	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
姓名	杜鹏	李芳菲
信息披露负责人	0755-83183388	010-68435588
联系电话	dupeng@dfcfund.com.cn	lfanglei@achina.com
电子邮箱	4008835558	95599
客户服务电话	0755-83199588	010-6842181
传真		

报告期末基金份额总额

7,397,235,977.87份

## § 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
深圳福田区深南大道8088号招商品牌大厦32层大成基金管理有限公司	深圳福田区深南大道8088号招商品牌大厦32层大成基金管理有限公司
基金年度报告备置地点	北京海淀区中关村环路100号金玉大厦中国农业银行托管业务部
传真	0755-83199588

报告期末基金份额总额

7,397,235,977.87份

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1 期间数据和指标	金额单位:人民币元
2008年	2007年
本期已实现收益	-267,818,605.82
本期利润	-7,154,028,047.15
加权平均基金份额本期利润	-1,0882
本期基金份额净值增长率	-64.77%
3.1.2 期末数据和指标	2008年
2007年	2006年4月16日(基金合同生效日)至2008年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.3823
期末基金资产净值	0.3273
期末基金资产净值	0.3066
期末基金资产净值	0.6177
3.2 基金净值表现	1.7533
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	1.6866
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	1.6866

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.所述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用,即费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.3 基金合同生效以来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 主要会计数据和财务指标

3.3.1 期间数据和指标	金额单位:人民币元
2008年	2007年
本期已实现收益	-267,818,605.82
本期利润	-7,154,028,047.15
加权平均基金份额本期利润	-1,0882
本期基金份额净值增长率	-64.77%
3.3.2 期末数据和指标	2008年
2007年	2006年4月16日(基金合同生效日)至2008年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.3823
期末基金资产净值	0.3273
期末基金资产净值	0.3066
期末基金资产净值	0.6177
3.4 过去三年基金的利润分配情况	1.7533

注:2006年度数据按自基金合同生效日2006年4月6日至2006年12月31日实际期间计算,并未按自然年度进行折算。

3.4.1 基金管理人及基金经理情况

3.4.2 基金管理人对报告期内基金运作的监督情况

3.4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.4.4 管理人对报告期内基金投资组合的跟踪情况

3.4.5 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.6 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.7 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.8 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.9 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.10 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.11 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.12 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.13 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.14 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.15 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.16 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.17 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.18 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.19 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.20 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.21 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.22 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.23 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.24 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.25 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.26 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.27 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.28 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.29 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.30 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.31 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.32 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.33 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.34 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.35 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.36 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.37 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.38 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.39 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.40 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.41 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.42 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.43 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.44 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.45 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.46 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.47 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.48 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.49 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.50 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.51 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.52 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.53 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.54 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.55 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.56 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.57 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.58 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.59 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.60 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况

3.4.61 管理人对报告期内基金投资组合的偏离情况