

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2011年3月25日核对了本基金报告中的财务指标、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。

基金经理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。

本年度报告摘要幅度自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务数据已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，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	大成沪深300指数
基金代码	519300
前端交易代码	519300
后端交易代码	519301
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
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
报告期末基金份额总额	9,038,687,823.51份
基金份额净值	1.00元

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的资产配置和数量化风险管理手段，实现指数投资偏度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏度的绝对值不超过35%，年度跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用指数化投资策略，即主要通过在持有的股票中选取的股票的权重以及其权重变化，复制标的指数，并根据上层根据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
风险收益特征	本基金为指数基金，是风险中等，获得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	杜鹏	李非非
信息披露负责人	0755-83183388	010-66060069
电子邮箱	dupeng@dfm.com.cn	lifangfei@china.com
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199888	010-63201816

2.4 信息披露方式

基金年度报告书面公告的管理人互联网网址	http://www.dfm.com.cn
基金管理年度报告置地	深圳市福田区深南大道7088号招行大厦12层大成基金管理有限公司

§ 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 利润分配指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期实现收益	74,495,797.80	-786,230,236.47	-267,818,605.82
本期利润	-734,268,117.42	3,771,307,256.44	-7,154,028,047.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0869	0.5680	-1.0826
本期基金份额净值增长率为	-12.67%	90.08%	-64.77%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供基金份额利润	0.0548	0.1729	-0.3823
期末基金份额净值	8,542,999,793.57	7,791,721,831.86	4,569,249,493.47
期末份额净值	0.9452	1.1741	0.6177

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)减去相关费用后的余额，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将低于不计费用的净值。

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

金额单位:人民币元

本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率的比较

本基金