

2013年8月29日 星期四

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:2013年8月29日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事监事会对本报告所载资料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签章确认。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月26日复核了本报告书中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、基金组合报告等内容，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摘要。

本半年度报告摘要自半年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自2013年01月01日起至2013年06月30日止。

1.2 基金简介

1.3 基金的基本情况

基金简称 大成沪深300指数

基金王代码 519300

前端交易代码 519300

后端交易代码 519301

基金运作方式 灵活配置开放式

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 6,405,201,856.10份

报告期末基金份额净值 不定期

1.4 基金产品声明

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏差偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市

场情况下，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

1.5 投资目标 基金的投资目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏差偏离度和跟踪误差的最小化。

在正常市场情况下，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

1.6 投资策略 基金的投资策略是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏差偏离度和跟踪误差的最小化。

在正常市场情况下，本基金每日跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

1.7 业绩比较基准 沪深300指数

1.8 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水平的产品。

1.9 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 李秀菲

信息披露负责人 联系电话 0755-83183388 010-66006069

电子邮件 dupeng@dfund.com.cn llifangfei@abchina.com

客户服务电话 4008885558 95599

传真 0755-83199588 010-63201816

1.10 信函披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网 http://www.dfund.com.cn

网址 深圳市福田区菊香路7088号招商银行大厦32层

基金半年度报告置地地点 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行托管业务部

1.11 \$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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 -118,132,456.19

加权平均基金份额本期利润 -515,901,077.14

-0.99%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.3042

期末基金份额净值 4,456,584.32973

0.6958

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入扣减公允价值变动收益、股利再投资相关费用后的余额,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.所涉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 基金的表决权表现

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(%) 基础收益率 基准收益率 准确度(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -13.58% 1.72% -15.57% 1.86% 1.99% -0.14%

过去三个月 -9.82% 1.33% -11.80% 1.45% 1.98% -0.12%

过去六个月 -10.99% 1.39% -12.78% 1.50% 1.79% -0.11%

过去一年 -8.35% 1.27% -10.60% 1.37% 2.25% -0.10%

过去三年 -11.41% 1.29% -14.14% 1.37% 2.73% -0.08%

自基金合同生效日起至今 69.25% 1.86% 99.47% 1.96% -30.22% -0.10%

3.2.2 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

注:按基金合同约定,本基金的最短存续期为6个月,截至本报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之(六)投资组合中规定的各项比例。

4. 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理费情况

4.1.1 基金管理费 及其管理费率的经

营收入情况

4.1.2 基金管理人及基金经理情况

4.1.3 基金经理的薪酬情况

4.1.4 基金管理人对报告期内基金运作的说明

4.1.5 基金管理人对报告期内基金的财务状况的说明

4.1.6 基金管理人对报告期内基金的风险揭示

4.1.7 基金管理人对基金未来发展的展望

4.1.8 其他需要说明的事项

4.2 基金管理人对基金年度报告编制的说明

4.3 管理人对报告期间基金运作的专项说明

4.4 管理人对报告期间基金交易情况的专项说明

4.5 管理人对报告期间基金投资策略的专项说明

4.6 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.7 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.8 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.9 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.10 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.11 管理人对报告期间基金投资组合的专项说明

4.12 基金经理对基金年度报告的说明

4.13 基金经理对基金年度报告的说明

4.14 基金经理对基金年度报告的说明

4.15 基金经理对基金年度报告的说明

4.16 基金经理对基金年度报告的说明

4.17 基金经理对基金年度报告的说明

4.18 基金经理对基金年度报告的说明

4.19 基金经理对基金年度报告的说明

4.20 基金经理对基金年度报告的说明

4.21 基金经理对基金年度报告的说明

4.22 基金经理对基金年度报告的说明

4.23 基金经理对基金年度报告的说明

4.24 基金经理对基金年度报告的说明

4.25 基金经理对基金年度报告的说明

4.26 基金经理对基金年度报告的说明

4.27 基金经理对基金年度报告的说明

4.28 基金经理对基金年度报告的说明

4.29 基金经理对基金年度报告的说明

4.30 基金经理对基金年度报告的说明

4.31 基金经理对基金年度报告的说明

4.32 基金经理对基金年度报告的说明

4.33 基金经理对基金年度报告的说明

4.34 基金经理对基金年度报告的说明

4.35 基金经理对基金年度报告的说明

4.36 基金经理对基金年度报告的说明

4.37 基金经理对基金年度报告的说明

4.38 基金经理对基金年度报告的说明

4.39 基金经理对基金年度报告的说明

4.40 基金经理对基金年度报告的说明

4.41 基金经理对基金年度报告的说明

4.42 基金经理对基金年度报告的说明

4.43 基金经理对基金年度报告的说明

4.44 基金经理对基金年度报告的说明

4.45 基金经理对基金年度报告的说明

4.46 基金经理对基金年度报告的说明

4.47 基金经理对基金年度报告的说明

4.48 基金经理对基金年度报告的说明

4.49 基金经理对基金年度报告的说明

4.50 基金经理对基金年度报告的说明

4.51 基金经理对基金年度报告的说明

4.52 基金经理对基金年度报告的说明

4.53 基金经理对基金年度报告的说明

4.54 基金经理对基金年度报告的说明

4.55 基金经理对基金年度报告的说明

4.56 基金经理对基金年度报告的说明

4.57 基金经理对基金年度报告的说明

4.58 基金经理对基金年度报告的说明

4.59 基金经理对基金年度报告的说明

4.60 基金经理对基金年度报告的说明

4.61 基金经理对基金年度报告的说明

4.62 基金经理对基金年度报告的说明

4.63 基金经理对基金年度报告的说明

4.64 基金经理对基金年度报告的说明

4.65 基金经理对基金年度报告的说明

4.66 基金经理对基金年度报告的说明

4.67 基金经理对基金年度报告的说明

4.68 基金经理对基金年度报告的说明

4.69 基金经理对基金年度报告的说明

4.70 基金经理对基金年度报告的说明

4.71 基金经理对基金年度报告的说明

4.72 基金经理对基金年度报告的说明

4.73 基金经理