

大成沪深 300 指数证券投资基金
【2013】半年度报告摘要

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	金额单位:人民币元
				占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	39,143,142.12	0.69
2	600036	招商银行	37,805,591.20	0.67
3	601328	交通银行	30,942,426.84	0.55
4	601318	中国平安	25,241,676.80	0.45
5	000002	万科A	23,727,193.26	0.42
6	601166	兴业银行	22,488,600.64	0.40
7	601939	建设银行	21,835,881.78	0.39
8	000776	广发证券	20,578,170.99	0.36
9	600000	浦发银行	20,011,081.15	0.35
10	600030	中信证券	15,826,258.17	0.28
11	600837	海通证券	15,659,287.36	0.28
12	601088	中国神华	12,239,338.95	0.22
13	600519	贵州茅台	11,787,516.81	0.21
14	000051	格力电器	10,301,724.59	0.19
15	601601	中国太保	10,317,174.54	0.18
16	600887	伊利股份	9,521,945.64	0.17
17	601398	工商银行	9,249,949.10	0.16
18	000001	平安银行	8,922,012.38	0.16
19	601668	中国建筑	8,842,938.72	0.16
20	600104	上汽集团	8,646,226.26	0.15

注:本期累计卖出金额指卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不扣除相关交易费用。

[illegible]

在信托方式下，大成300指数证券投资基金的过程中，基金管理人中国银河投资管理有限公司受托管理大成300指数证券投资基金以及大成300指数证券投资基金子基金。大成300指数证券投资基金的基金合同、招募说明书等法律文件均明确约定了基金管理人应履行的受托人义务。大成基金自2009年3月成立至2013年6月30日基金管理期间，进行了认真的会计核算和有效的投资监督，认真履行了其受托人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人为：大成基金管理有限公司在大成300指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的核算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，未有重大违法违规行为的发生。

本托管人对本半年度报告中涉及财务信息等内容均真实、准确和完整发表意见。本托管人认为，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，基金管理人编制和披露的大成沪深300指数证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成沪深300指数证券投资基金

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	415,217,204.78	480,801,589.16
结算备付金	-	-

存出保证金	392,823.82	250,000.00
交易性金融资产	4,033,691,922.00	5,188,509,505.90
其中：股票投资	4,033,691,922.00	5,188,509,505.90
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	102,847.09	72,961.11
应收股利	13,938,288.64	-
应收申购款	690,343.01	526,127.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,464,033,429.34	5,670,160,183.52
负债和所有者权益		
	本期末	上年度末
	2013年6月30日	2012年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
应付账款	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付债券	-	-
长期应付款	-	-
专项应付款	-	-
其他应付款	-	-
其他流动负债	-	-
其他非流动负债	-	-
负债合计	-	-
所有者权益：		
实收资本	-	-
资本公积	-	-
盈余公积	-	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	-	-



存出保证金	392,823.82	250,000.00
交易性金融资产	4,033,691,922.00	5,188,509,505.90
其中：股票投资	4,033,691,922.00	5,188,509,505.90
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	102,847.09	72,961.11
应收股利	13,938,288.64	-
应收申购款	690,343.01	526,127.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,464,033,429.34	5,670,160,183.52
负债和所有者权益		
	本期末	上年度末
	2013年6月30日	2012年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
应付账款	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付债券	-	-
长期应付款	-	-
专项应付款	-	-
其他应付款	-	-
其他流动负债	-	-
其他非流动负债	-	-
负债合计	-	-
所有者权益：		
实收资本	-	-
资本公积	-	-
盈余公积	-	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	-	-

6.2 利润表

会计主体: 大成沪深300指数证券投资基金

本报告期: 2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
一、收入	-489,839,718.79	331,489,455.73
1.利息收入	1,478,086.68	1,287,185.11
其中:存款利息收入	1,478,086.68	1,287,185.11
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-94,076,764.25	-180,118,724.66
其中:股票投资收益	-151,953,514.15	-242,968,232.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-	-
股利收益	57,876,749.90	-	62,849,507.76
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-397,768,620.95	-	510,088,062.84
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	527,579.73	-	232,932.44
减:二、费用	26,061,358.35	-	28,085,959.50
1.管理人报酬	19,611,716.81	-	21,622,033.19
2.托管费	3,922,343.37	-	4,324,406.63
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用	2,297,395.83	-	1,919,410.06
5.利息支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.其他费用	229,902.34	-	220,109.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-515,901,077.14	-	303,403,496.19
减:所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-515,901,077.14	-	303,403,496.19

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:大成沪深300指数证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,242,994,681.20	-1,581,189,759.51	5,661,804,921.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-515,901,077.14	-515,901,077.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(基金份额变动)	-837,792,825.10	148,473,310.28	-689,319,514.82

其中：1.基金申购款	554,367,566.95	-113,691,619.36	440,675,947.59
2.基金赎回款	-1,392,160,392.05	262,164,929.64	-1,129,995,462.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,405,201,856.10	-1,948,617,526.37	4,456,584,329.73
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,563,636,558.17	-2,113,746,242.32	5,449,890,315.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	303,403,496.19	303,403,496.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-263,614,402.54	52,452,744.27	-211,161,658.27
其中：1.基金申购款	366,716,165.60	-81,505,306.02	285,210,859.58
2.基金赎回款	-630,330,568.14	133,958,050.29	-496,372,517.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	7,300,022,155.63	-1,757,890,001.86	5,542,132,153.77

报表附注为财务报表提供附加说明。

本报告自 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：
 基金管理人负责人：王颐 主管会计工作负责人：刘影碧 会计机构负责人：范瑛

4	600837	通证证券	13,271,674.58	0.23
5	600157	永泰能源	11,057,405.92	0.20
6	600886	国投电力	10,498,768.06	0.19
7	601800	中国交建	10,442,887.25	0.18
8	601336	新华保险	10,047,842.61	0.18
9	600340	华夏幸福	9,790,855.72	0.17
10	600637	百保通	9,717,567.86	0.17
11	002375	亚夏股份	8,159,840.99	0.14
12	000750	国海证券	7,743,444.00	0.14
13	600027	华电国际	7,292,343.00	0.13
14	600016	民生银行	6,553,297.23	0.12
15	600582	天地科技	5,832,976.47	0.10
16	601238	广汽集团	5,644,558.93	0.10
17	601318	中国平安	4,313,561.00	0.08
18	601688	华泰证券	4,282,609.86	0.08
19	002594	比亚迪	4,282,172.45	0.08
20	601166	兴业银行	4,187,922.90	0.07

注：A类累计买入金额指买入成交金额，截至单价乘以成交数量，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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(%)
1	600016	民生银行	39,143,142.22	0.69
2	600036	招商银行	37,805,591.10	0.67
3	601328	交通银行	30,942,426.84	0.55
4	601318	中国平安	25,241,676.80	0.45
5	000002	万科A	23,727,193.26	0.42
6	601166	兴业银行	22,488,600.64	0.40
7	601939	建设银行	21,835,881.78	0.39
8	000776	广发证券	20,578,170.99	0.36
9	600000	浦发银行	20,011,081.15	0.35
10	600030	中信证券	15,826,258.17	0.28
11	600837	海通证券	15,659,287.36	0.28
12	601088	中国神华	12,239,388.95	0.22
13	600519	贵州茅台	11,787,516.81	0.21
14	000651	格力电器	10,817,124.59	0.19
15	601601	中国太保	10,301,774.54	0.18
16	600887	伊利股份	9,521,945.64	0.17
17	601389	工商银行	9,349,949.06	0.16

18	000001	平安银行	8,922,012.38	0.16
19	601668	中国建筑	8,842,938.72	0.16
20	600104	上汽集团	8,640,226.27	0.15

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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

单位：人民币元

① 买入股票成本（成交金额）	352,585,289.47
----------------	----------------

卖出股票费用收入(成交)总额	957,600,848.27
注：上述金额扣除成交金额、成交价格和成交数量后，不考虑交易费用。	
7.5 期末按投资组合品种分类的资产净值比例	
本基金本报告期末未持有债券投资。	
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	
本基金本报告期末未持有债券投资。	
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	
本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。	
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	
本基金本报告期末未持有权证投资。	
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细	
本基金本报告期末无股指期货持仓。	
7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策	
本基金本报告期末无股指期货持仓。	

卖出股票费用收入(成交)总额	957,600,848.27
注：上述金额扣除成交金额、成交价格和成交数量后，不考虑交易费用。	
7.5 期末按投资组合品种分类的资产净值比例	
本基金本报告期末未持有债券投资。	
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	
本基金本报告期末未持有债券投资。	
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	
本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。	
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	
本基金本报告期末未持有权证投资。	
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细	
本基金本报告期末无股指期货持仓。	
7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策	
本基金本报告期末无股指期货持仓。	

7.1.0.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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、处罚的情形。

7.1.0.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.1.0.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币
1	存出保证金	392,823.82	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	13,938,288.64	
4	应收利息	102,847.09	
5	应收申购款	690,343.01	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	15,124,302.56	

7.1.0.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.1.0.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

7.1.0.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.1.0.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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、处罚的情形。

7.1.0.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.1.0.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币
1	存出保证金	392,823.82	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	13,938,288.64	
4	应收利息	102,847.09	
5	应收申购款	690,343.01	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	15,124,302.56	

7.1.0.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.1.0.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

7.1.0.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.1 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有结构	份额单位：份	持有人结构			
持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	机构投资者	个人投资者		
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
331,752	19,307.20	262,602,679.45	4.10%	6,142,599,176.65	95.90%

注：持有户数大于有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人从事从业人员持有本基 金	516,415.83	0.008%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：0-10万份

以上。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
331,752	19,307.20	262,602,679.45	4.10%	6,142,599,176.65	95.90%

注：持有1万户及以上有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人从事从业人员持有本基 金	516,415.83	0.008%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：0-10万份
以上。

2.本基金的前置审批程序:本基金份额认购、申购和赎回时间同: \$9 开放式基金份额变动		单位:份
基金合同生效日(2006年4月6日)	基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额		7,242,994,681.20
本报告期基金总申购份额		554,367,566.95
减:本报告期基金总赎回份额		1,392,160,392.05
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期期末基金份额总额		6,405,201,856.10
\$10 重大事件揭示		
10.1 基金份额持有人大会决议		
报告期内无基金份额持有人大会决议。		

2.本基金的前置审批程序:本基金份额认购、申购和赎回时间同: \$9 开放式基金份额变动		单位:份
基金合同生效日(2006年4月6日)	基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额		7,242,994,681.20
本报告期基金总申购份额		554,367,566.95
减:本报告期基金总赎回份额		1,392,160,392.05
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期末基金份额总额		6,405,201,856.10
\$10 重大事件揭示		
10.1 基金份额持有人大会决议 报告期内无基金份额持有人大会决议。		

2.本基金的前置审批程序:本基金份额认购、申购和赎回时间同: \$9 开放式基金份额变动		单位:份
基金合同生效日(2006年4月6日)	基金份额总额	1,813,356,066.47
本报告期期初基金份额总额		7,242,994,681.20
本报告期基金总申购份额		554,367,566.95
减:本报告期基金总赎回份额		1,392,160,392.05
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期期末基金份额总额		6,405,201,856.10
\$10 重大事件揭示		
10.1 基金份额持有人大会决议 报告期内无基金份额持有人大会决议。		

报告期内托管人、基金管理人为维护基金份额持有人的最大利益受到中国证监会行政处罚，基金管理人、基金托管人、基金托管业务的专门机构均无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期间没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资原则的改变

本基金投资策略在本报告期间内没有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处分等情况

本报告期间，托管人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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用于股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元					
券商名称	交易数量 股数	成交金额	股票交易	佣金	备注
			占当期股票 成交总额的比例		占当期佣金 总量的比例
光大证券	2	643,236,743.49	49.21%	578,945.26	49.05%