

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:2012年3月28日

基金管理人承诺:基金管理人承诺不以虚假陈述、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法律责任。
基金托管人承诺:基金托管人承诺不以虚假陈述、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法律责任。

大成沪深300指数证券投资基金

2011年度 报告摘要

2011年12月31日

2.1 基金基本情况
基金简称:大成沪深300
基金代码:510300
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

2.2 基金业绩说明
投资目标:通过严格的选股程序和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略:本基金采用被动式指数投资策略,原则上,复制标的指数的构成及其权重,并采用抽样复制的方式进行跟踪。

2.3 基金管理人和其他基金托管人
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

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标
2011年 2010年 2009年
本期利润总额 -1,633,236,720.57 -734,238,117.42 3,771,307,266.44

3.1.2 期间费用和指标
2011年末 2010年末 2009年末
期末基金份额净值 5.449,890.31585 8.542,999,793.57 7,791,721,831.86

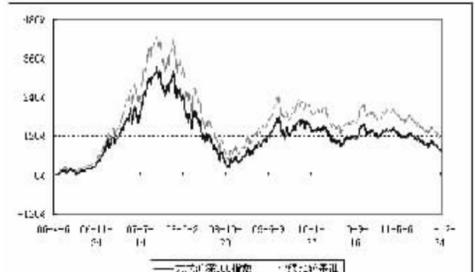
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
阶段 份额净值增长率 业绩比较基准 ①-③

过去三个月 -8.83% 1.33% -9.13% 0.30% -0.08%
过去六个月 -21.92% 1.28% -22.94% 1.36% -0.08%
过去一年 -23.77% 1.22% -25.01% 1.59% -0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:基金合同规定,本基金的初始建仓期为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规定投资组合比例的范围。

3.3 过去三年基金的费用分配情况

3.3 过去三年基金的费用分配情况
单位:人民币元
年度 每100份基金份额的股息 现金形式发放总额 再投资形式发放总额 年度利润分配合计

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.2 基金管理人报告

4.2.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.3 基金管理人报告

4.3.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.4 基金管理人报告

4.4.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.5 基金管理人报告

4.5.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.6 基金管理人报告

4.6.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.7 基金管理人报告

4.7.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.8 基金管理人报告

4.8.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.9 基金管理人报告

4.9.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.10 基金管理人报告

4.10.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

4.11 基金管理人报告

4.11.1 基金管理人及基金托管人的简介
大成基金管理有限公司:成立于1999年4月12日,是中国证监会批准成立的十家基金管理公司之一,注册资本为2亿元人民币,注册地为深圳。
中国农业银行股份有限公司:成立于1985年,是中国最大的农业政策性银行。

7.4.3.1.2 债券交易

7.4.3.1.2 债券交易
本期 上期
成交金额 1,246,424.50 4,876

7.4.3.1.3 债券回购交易

7.4.3.1.3 债券回购交易
本期 上期
成交金额 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.1.4 关联方交易

7.4.3.1.4 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.2 关联方交易

7.4.3.2 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.3 基金管理人

7.4.3.3 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.4 关联方交易

7.4.3.4 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.5 基金管理人

7.4.3.5 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.6 关联方交易

7.4.3.6 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.7 基金管理人

7.4.3.7 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.8 关联方交易

7.4.3.8 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.9 基金管理人

7.4.3.9 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.10 关联方交易

7.4.3.10 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.11 基金管理人

7.4.3.11 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.12 关联方交易

7.4.3.12 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.13 基金管理人

7.4.3.13 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.14 关联方交易

7.4.3.14 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.15 基金管理人

7.4.3.15 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.16 关联方交易

7.4.3.16 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.17 基金管理人

7.4.3.17 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.18 关联方交易

7.4.3.18 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.19 基金管理人

7.4.3.19 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.20 关联方交易

7.4.3.20 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.21 基金管理人

7.4.3.21 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.22 关联方交易

7.4.3.22 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.23 基金管理人

7.4.3.23 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.24 关联方交易

7.4.3.24 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.25 基金管理人

7.4.3.25 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.26 关联方交易

7.4.3.26 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.27 基金管理人

7.4.3.27 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.1.2 债券交易

7.4.3.1.2 债券交易
本期 上期
成交金额 1,246,424.50 4,876

7.4.3.1.3 债券回购交易

7.4.3.1.3 债券回购交易
本期 上期
成交金额 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.1.4 关联方交易

7.4.3.1.4 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.2 关联方交易

7.4.3.2 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.3 基金管理人

7.4.3.3 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.4 关联方交易

7.4.3.4 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.5 基金管理人

7.4.3.5 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.6 关联方交易

7.4.3.6 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.7 基金管理人

7.4.3.7 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.8 关联方交易

7.4.3.8 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.9 基金管理人

7.4.3.9 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.10 关联方交易

7.4.3.10 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.11 基金管理人

7.4.3.11 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.12 关联方交易

7.4.3.12 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.13 基金管理人

7.4.3.13 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.14 关联方交易

7.4.3.14 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.15 基金管理人

7.4.3.15 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.16 关联方交易

7.4.3.16 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.17 基金管理人

7.4.3.17 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.18 关联方交易

7.4.3.18 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.19 基金管理人

7.4.3.19 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.20 关联方交易

7.4.3.20 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.21 基金管理人

7.4.3.21 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.22 关联方交易

7.4.3.22 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.23 基金管理人

7.4.3.23 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.24 关联方交易

7.4.3.24 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.25 基金管理人

7.4.3.25 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

7.4.3.26 关联方交易

7.4.3.26 关联方交易
本期 上期
成交金额 928,585,454.83 17,496

7.4.3.27 基金管理人

7.4.3.27 基金管理人
本期 上期
管理费 10,242,188.58 11,885,728.81

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:本期累计买入金额买入成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.4.3 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:上述金额均指成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.5 期末按品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:上述金额均指成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:上述金额均指成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:上述金额均指成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例
1 001318 中国平安 86,829,677.12 1.02

注:上述金额均指成交金额(成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本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、处罚的情况

8.9.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.3 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.4 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.5 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.6 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.7 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.8 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.9 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.10 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.11 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.12 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.13 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.14 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.15 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.16 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.17 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.18 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.19 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.20 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司

8.9.21 基金投资的前十名权证中,没有投资于涉及重大资产重组的上市公司