

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

\$1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对本报告所载资料的存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担相应的法律责任。基金托管人对本报告的内容不承担任何责任。本报告由基金管理人负责编制，未经托管人复核。财务数据未经审计，投资报告基金净值、资产配置报告、投资策略、投资风险、投资运作在投资决策层面对阅读本基金的招募说明书及其更新报告、本报告拟披露前阅读半年报全文、投资人欲了解详细情况，应阅读半年报全文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者在查阅报告时应加以注意。

报告期自2011年1月1日起至2011年12月31日止。

\$2 基金简介

基金基本情况 大成成长40ETF

基金主代码 159006

交易代码 159006

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2010年12月21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

报告期基金份额总额 2,101,639,725.00份

基金合同存续期 不定期

基金上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011年1月23日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息上显示为“新成长”。

2.2 基金产品说明

紧密跟踪标的指数,追求与标的指数相似的回报率。

本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及权重配置基金资产,以求得尽可能地跟踪标的指数的表现。

投资策略 相关的指数成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红、送股、分红行为时,或因基金申购和赎回等对基金资产规模的影响,或因其他原因导致不能完全复制时,基金管理人将根据风险管理的原则,在综合考虑跟踪误差风险和跟踪成本的基础上,选择合适的投资组合,以期在一定程度上规避基金资产净值的跟踪误差风险。

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息上显示为“新成长”。

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据指标 2011年 2010年12月21日 本基金合同生效日-2010年12月31日

本期实现收益 -147,965,639.78 -195,424.18

本期利润 -575,586,13.98 2,309,126.32

加权平均基金份额本期利润 -0.3095 0.0046

本期基金份额净值增长 -27.96% 0.50%

3.1.2 利润数据指标 2011年末 2010年末

期末基金份额利润 -0.2760 -0.0004

期末基金份额净值 1,521,513,865.62 500,948,851.32

期末基金份额净值增长率 0.724 1.005

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,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.2.2 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

注:本基金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,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 基金净值表现

3.2.3 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

注:本基金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,本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.3.2 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.3 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.4 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.5 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.6 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.7 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.8 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.9 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.10 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.11 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.12 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.13 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.14 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.15 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.16 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.17 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.18 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.19 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.20 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.21 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.22 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.23 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.24 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.25 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.26 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.27 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.28 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.29 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.30 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.31 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.32 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.33 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.34 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.35 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.36 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.37 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.38 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.39 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.40 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.41 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.42 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.43 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.44 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.45 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.46 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.47 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.48 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.49 本基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

3.3.50 本基金合同生效以来基金