

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8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性及完整性承担个别及连带法律责任。本半年度报告已于2012年7月21日由董事长签发。
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”)根据本基金合同约定,于2012年8月21日复核了本报告中的财务指标、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或因基金价格波动而遭受损失。
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

基金名称	大成中证内地消费主题指数
基金代码	090016
交易代码	090016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月8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
基金合同终止日	不定期,详见招募说明书
基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险收益水平高于混合型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种,其风险和收益均高于货币市场基金、债券基金、保本型基金及货币市场基金等低风险品种。

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

基金管理人及基金托管人	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
-------------	--

基金销售机构	大成基金直销及各大代销机构
--------	---------------

基金业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
----------	-------------------------------

大成中证内地消费主题指数证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

基金管理人在2012年1月1日至2012年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立、客观的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性及完整性承担个别及连带法律责任。本半年度报告已于2012年7月21日由董事长签发。
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”)根据本基金合同约定,于2012年8月21日复核了本报告中的财务指标、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或因基金价格波动而遭受损失。
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告自2012年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:大成中证内地消费主题指数
基金代码:090016
交易代码:090016
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年11月8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
基金合同终止日:不定期,详见招募说明书
基金销售机构:大成基金直销及各大代销机构

2.2 基金产品说明
投资目标:通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,本基金力争年复合净值收益率与业绩比较基准之间的差距控制在±0.4%以内,以期获得超越业绩比较基准的投资收益和资产增值。
投资策略:本基金为被动跟踪指数基金,采用完全复制的策略跟踪标的指数的表现,力求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,本基金力争年复合净值收益率与业绩比较基准之间的差距控制在±0.4%以内,以期获得超越业绩比较基准的投资收益和资产增值。
风险收益特征:中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
本基金属股票型基金,风险收益水平高于混合型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种,其风险和收益均高于货币市场基金、债券基金、保本型基金及货币市场基金等低风险品种。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 基金投资方式
基金业绩比较基准:中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.5 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.6 基金管理人及基金托管人
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

2.7 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.8 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.9 基金管理人及基金托管人
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

2.10 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.11 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.12 基金管理人及基金托管人
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

2.13 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.14 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.15 基金管理人及基金托管人
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

2.16 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.17 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.18 基金管理人及基金托管人
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

2.19 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.20 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.21 基金管理人及基金托管人
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

2.22 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.23 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.24 基金管理人及基金托管人
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

2.25 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.26 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.27 基金管理人及基金托管人
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

2.28 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.29 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.30 基金管理人及基金托管人
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

2.31 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.32 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.33 基金管理人及基金托管人
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

2.34 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.35 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.36 基金管理人及基金托管人
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

2.37 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.38 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.39 基金管理人及基金托管人
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

2.40 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

2.41 基金业绩比较基准
中证内地消费主题指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

2.42 基金管理人及基金托管人
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

2.43 基金销售机构
大成基金直销及各大代销机构

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	37,821	9,044,892.15	12.10
2	200858	五洲制药	172,823	5,661,684.78	7.58
3	000651	格力电器	191,653	3,995,965.05	5.35
4	002204	洋河股份	29,482	3,966,803.10	5.31
5	002024	苏宁电器	382,205	3,206,699.95	4.29
6	600828	伊力特	145,499	2,994,362.40	4.03
7	600104	上汽集团	200,766	2,888,946.14	3.84
8	001988	华鲁恒升	65,473	2,685,542.83	3.59
9	000669	国电南瑞	331,713	2,111,862.94	2.83
10	000527	华谊兄弟	184,875	2,042,868.75	2.73

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有投资明细,应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的半年度报告正文。
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五洲制药	20,880,017.23	2.46
2	600519	贵州茅台	16,043,990.50	2.13
3	002204	苏宁电器	12,659,567.18	1.49
4	002204	洋河股份	12,176,550.30	1.44
5	600104	上汽集团	11,487,326.35	1.35
6	000568	伊力特	8,944,264.59	1.05
7	000527	华谊兄弟	8,905,372.42	1.05
8	000641	华鲁恒升	8,883,046.22	1.04
9	000995	华鲁恒升	7,118,071.76	0.84
10	600690	青岛啤酒	5,178,527.10	0.61
11	000010	TCL集团	5,050,437.00	0.59
12	600660	福耀玻璃	4,685,707.22	0.55
13	600177	恒力发电	4,484,362.26	0.53
14	600600	青岛啤酒	4,178,422.90	0.49
15	000881	威孚高科	4,001,428.27	0.47
16	600415	小商品城	3,701,786.87	0.44
17	000744	华鲁恒升	3,563,328.73	0.42
18	600555	莱钢股份	3,545,163.99	0.42
19	000669	国电南瑞	3,408,913.59	0.40
20	600166	福耀玻璃	3,309,878.27	0.39

注:本期累计买入金额未包含成交金额(或成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	600519	贵州茅台	20,847,359.50	2.46
2	000858	五洲制药	16,130,169.64	1.92
3	600887	伊力特	15,442,703.85	1.82
4	000651	格力电器	10,102,434.83	1.19
5	002204	洋河股份	10,028,173.32	1.18
6	002024	苏宁电器	9,979,993.33	1.18
7	600104	上汽集团	9,686,216.24	1.02
8	000568	伊力特	7,105,267.41	0.84
9	000527	华谊兄弟	6,808,796.69	0.81
10	000995	华鲁恒升	5,141,686.66	0.61
11	600188	中国国旅	4,320,645.81	0.51
12	600690	青岛啤酒	4,200,316.62	0.50
13	400010	TCL集团	3,814,675.19	0.45
14	600660	福耀玻璃	3,647,704.04	0.43
15	600177	恒力发电	3,427,825.71	0.40
16	600600	青岛啤酒	3,248,543.96	0.38
17	600699	国电南瑞	3,084,725.65	0.36
18	000881	威孚高科	2,921,999.98	0.34
19	600415	小商品城	2,909,657.74	0.34

注:本期累计卖出金额未包含成交金额(或成交金额以成交数量),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

买入股票成本(成交总额)	213,916,914.17
卖出股票收入(成交总额)	200,398,784.13

注:上述金额均指公允价值(或成交金额以成交数量),不考虑相关交易费用。
7.5 期末按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资组合。
7.6 期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资组合。
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序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 投资组合报告附注
7.9.1 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的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
7.9.2 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。
7.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	数量	金额
1	存出保证金		117,678.34
2	应收证券清算款		1,341,890.16
3	应收账款		53,916.12
4	应收利息		1,057.67
5	应收申购款		298,011.92
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	预付款项		-
9	合计		1,812,532.11

7.9.4 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。
7.9.5 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不存在流通受限情况。
7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户持有的基金份额	机构投资者	个人投资者
		持有份额	持有份额
		持有份额	持有份额
5,084	14,874,596	9,481,483.02	5,393,112.57
		占份额比例	占份额比例
		64.82%	35.98%

注:持有人人数为有效户数,即存在份额为零的账户。
8.2 期末基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
基金管理人持有本基金管理人持有基金份额	2,254.61	0