大成沪深300指数证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
送出日期：2013年3月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月22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。

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更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2012年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成沪深300指数
基金主代码	519300
前端交易代码	519300
后端交易代码	519301
基金运作方式	契约型开放式
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	7,242,994,681.20份
基金合同存续期	不定期

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，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	沪深300指数
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的产品。

2.3 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
信息披露负责人	姓名	杜鹏	李芳菲
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司 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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-339,704,772.74	-100,768,369.85	74,495,797.80
本期利润	462,384,792.32	-1,633,536,720.57	-734,268,117.42
加权平均基金份额本期利润	0.0628	-0.2046	-0.0869
本期基金份额净值增长率	8.49%	-23.77%	-12.67%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2183	-0.2795	-0.0548
期末基金资产净值	5,661,804,921.69	5,449,890,315.85	8,542,999,793.57
期末基金份额净值	0.7817	0.7205	0.9452

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。

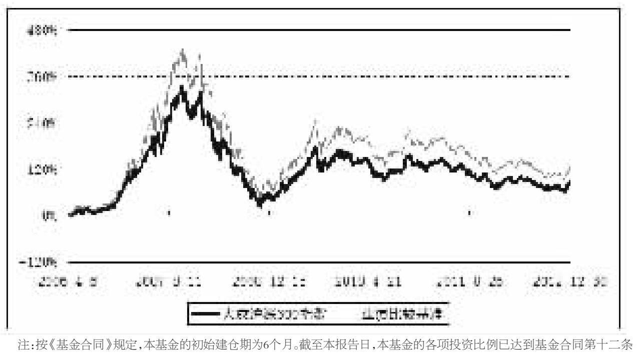
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

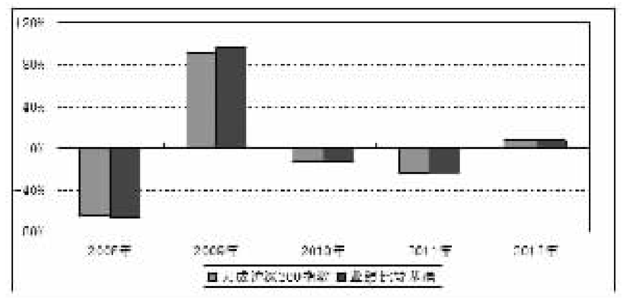
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.48%	1.20%	10.02%	1.28%	-0.54%	-0.08%
过去六个月	2.96%	1.16%	2.49%	1.24%	0.47%	-0.08%
过去一年	8.49%	1.20%	7.55%	1.28%	0.94%	-0.08%
过去三年	-27.78%	1.32%	-29.44%	1.39%	1.66%	-0.07%
过去五年	-51.64%	1.88%	-52.74%	1.98%	1.10%	-0.10%
自基金合同生效起至今	90.15%	1.89%	128.69%	1.99%	-38.54%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按《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（六）投资组合中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	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	备注
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	0.9000	349,842,743.27	264,925,320.60	614,768,063.87	
合计	0.9000	349,842,743.27	264,925,320.60	614,768,063.87	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批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。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2012年12月31日，本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金及景福证券投资基金，2只ETF及2只ETF联接基金：深证成长40ETF、大成深证成长40ETF联接基金、中证500沪市ETF及大成中证500沪市ETF联接基金，1只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1只QDII基金：大成标普500等权重指数基金及25只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡琦先生	本基金基金经理	2011年6月15日	2012年12月31日	9年	博士。2003年3月至2008年7月就职于财富证券有限责任公司，历任研发中心研究员、战略规划部副总经理以及金融工程部主管投资副总经理；2008年8月至2010年10月在深圳证券交易所博士后工作站从事研究工作。2010年10月加入大成基金管理有限公司。2011年5月18日至2013年3月6日担任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2011年6月15日至2012年12月31日任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2011年11月8日至2013年3月6日担任大成中证内地消费主题指数基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
苏秉毅先生	本基金基金经理	2013年1月1日	-	8年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年2月9日起担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012年8月28日起任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成沪深300指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，资产管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。资产管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量10%。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2012年基金管理人旗下主动投资组合间股票交易存在6笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的情况有9次，原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量5%。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年12月份以来，以金融、地产为龙头的权重股引领市场走出了一波大级别的上涨，截止春节前，沪深300指数、中小板指数和创业板指数的涨幅均超过30%，市场普涨的特征明显。短期的经济数据也透露出一定的经济回暖信号，支撑了行情的发展。国际方面，主要发达经济体继续释放流动性，与之前量化宽松不同的是美元开始趋势性地走强。美元的走强对全球资本的流动将产生重要的影响。

在运作期内，本基金较好地跟踪了沪深300指数，截止2012年12月31日，基金年化跟踪误差1.33%，日均偏离度0.06%，各项指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7817元，本报告期基金份额净值增长率为8.49%，同期业绩比较基准收益率为7.55%，高于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管人民币走向世界的道路还很漫长，但是人民币资产已经开始走向世界。做大人民币资产的大池子是当前金融市场改革的一个战略方向。股票市场的存量已经初具规模，其规模发展对外延扩张模式的依赖度逐渐下降，更多的是需要通过估值的提升来实现规模增长。引入外来投资者和新机构投资者的步伐一定程度上与中国股票市场的规模发展紧密相连。在该大背景下，股票市场的投资环境会出现实质性和趋势性的改善。

本基金将坚持被动型的指数化投资理念，继续深入研究更加高效的交易策略、风险控制方法，以期更好的跟踪指数，积极应对大额、频繁申购赎回及其他突发事件的影响，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管大成沪深300指数证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《大成沪深300指数证券投资基金基金合同》、《大成沪深300指数证券投资基金托管协议》的约定，对大成沪深300指数证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在大成沪深300指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理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，基金管理人所编制和披露的大成沪深300指数证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2012 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成沪深300指数证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	480,801,589.16	312,247,924.49
结算备付金	-	78,261.46
存出保证金	250,000.00	332,069.04
交易性金融资产	5,188,509,505.90	5,094,889,169.09
其中：股票投资	5,188,509,505.90	5,094,889,169.09
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	-	47,755,925.58
应收利息	72,961.11	62,975.92
应收股利	-	-
应收申购款	526,127.35	354,445.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,670,160,183.52	5,455,720,771.00
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,274,433.55	478,465.26
应付管理人报酬	3,318,652.45	3,591,956.93
应付托管费	663,730.49	718,391.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	591,539.78	370,034.09
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	506,905.56	671,607.50
负债合计	8,355,261.83	5,830,455.15
所有者权益：		
实收基金	7,242,994,681.20	7,563,636,558.17
未分配利润	-1,581,189,759.51	-2,113,746,242.32
所有者权益合计	5,661,804,921.69	5,449,890,315.85
负债和所有者权益总计	5,670,160,183.52	5,455,720,771.00

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值人民币0.7817元，基金份额总额7,242,994,681.20份。

7.2 利润表

会计主体：大成沪深300指数证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	515,156,624.92	-1,559,942,562.42
1.利息收入	2,650,822.28	3,081,073.16
其中：存款利息收入	2,650,822.28	3,049,571.09
债券利息收入	-	31,502.07
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）	-289,992,590.62	-33,323,753.74
其中：股票投资收益	-386,464,169.07	-115,251,406.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,234,029.66
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	96,471,578.45	79,693,623.56
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	802,089,565.06	-1,532,768,350.72
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	408,828.20	3,068,468.88
减：二、费用	52,771,832.60	73,594,158.15
1. 管理人报酬	41,317,077.42	53,564,344.19
2. 托管费	8,263,415.52	10,712,868.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,719,049.28	8,870,060.25
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	472,290.38	446,884.86
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	462,384,792.32	-1,633,536,720.57
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	462,384,792.32	-1,633,536,720.57

7.3 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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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）	-	462,384,792.32	462,384,792.32
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）	-320,641,876.97	70,171,690.49	-250,470,186.48
其中：1.基金申购款	741,979,252.24	-185,473,887.48	556,505,364.76
2.基金赎回款	-1,062,621,129.21	255,645,577.97	-806,975,551.24
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）	7,242,994,681.20	-1,581,189,759.51	5,661,804,921.69

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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）	9,038,687,823.51	-495,688,029.94	8,542,999,793.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,633,536,720.57	-1,633,536,720.57
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）	-1,475,051,265.34	15,478,508.19	-1,459,572,757.15
其中：1.基金申购款	1,776,458,815.52	-146,917,060.02	1,629,541,755.50
2.基金赎回款	-3,251,510,080.86	162,395,568.21	-3,089,114,512.65
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）	7,563,636,558.17	-2,113,746,242.32	5,449,890,315.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王颢　　主管会计工作负责人：刘彩晖　　会计机构负责人：范瑛

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司("大成基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司("广东证券")	基金管理人的股东

注：1）于2012年度，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

2）中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

3）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	99,553,787.58	5.99%	928,585,654.83	17.40%

7.4.3.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	-	0.00%	1,246,424.50	4.87%

7.4.3.1.3 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.3.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	85,771.06	5.99%	17,330.19	2.93%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	771,411.36	17.21%	208,332.22	56.30%

注：1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2)该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	41,317,077.42	53,564,344.19
其中：支付销售机构的客户维护费	9,506,190.67	10,942,188.58

注：1)基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2) 基金管理费于2012年末尚未支付的金额为人民币3,318,652.45元，于2011年末尚未支付的金额为人民币3,591,956.93元。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,263,415.52	10,712,868.85

注：1)基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

2) 基金托管费于2012年末尚未支付的金额为人民币663,730.49元，于2011年末尚未支付的金额为人民币718,391.37元。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金合同生效日（2006年4月6日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	108,077,930.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	108,077,930.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：基金管理人赎回本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资于本基金。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	480,801,589.16	2,641,998.42	312,247,924.49	3,016,977.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
光大证券	600595	中孚实业	配股发行	259,082	1,896,480.24

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.4 期末（ 2012年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600100	同方股份	2012/12/27	重大事项	7.48	2013/1/10	7.90	1,702,707.00	17,044,898.27	12,736,248.36	-
000002	万 科A	2012/12/26	重大事项	10.62	2013/1/21	11.13	10,367,116.00	94,501,830.18	110,098,771.92	-
000527	美的电器	2012/8/27	重大事项	9.69	-	-	2,174,458.00	25,762,410.18	21,070,498.02	-

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,188,509,505.90	91.51
	其中：股票	5,188,509,505.90	91.51
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	480,801,589.16	8.48
6	其他各项资产	849,088.46	0.01
7	合计	5,670,160,183.52	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	31,789,992.55	0.56
B	采掘业	515,133,189.80	9.10
C	制造业	1,692,788,980.36	29.90
C0	食品、饮料	323,876,836.16	5.72
C1	纺织、服装、皮毛	12,887,594.31	0.23
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	105,026,151.59	1.85
C5	电子	83,258,659.79	1.47
C6	金属、非金属	388,016,660.79	6.85
C7	机械、设备、仪表	544,647,243.63	9.62
C8	医药、生物制品	228,596,394.09	4.04
C99	其他制造业	6,479,440.00	0.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	124,482,363.32	2.20
E	建筑业	194,741,425.83	3.44
F	交通运输、仓储业	127,152,891.62	2.25
G	信息技术业	122,381,963.17	2.16
H	批发和零售贸易	119,165,665.55	2.10
I	金融、保险业	1,801,764,975.51	31.82
J	房地产业	327,033,833.67	5.78
K	社会服务业	39,712,523.85	0.70
L	传播与文化产业	14,540,332.48	0.26
M	综合类	77,821,368.19	1.37
	合计	5,188,509,505.90	91.64

8.3 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

金额单位：人民币元

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	600036	招商银行	17,278,441	237,578,563.75	4.20
2	600016	民生银行	23,052,620	181,193,593.20	3.20
3	601318	中国平安	3,419,484	154,868,430.36	2.74
4	601166	兴业银行	7,705,761	128,609,151.09	2.27
5	601939	建设银行	25,272,998	116,255,790.80	2.05
6	600000	浦发银行	11,422,372	113,309,930.24	2.00
7	000002	万 科A	10,367,116	110,098,771.92	1.94
8	601328	交通银行	20,028,924	98,942,884.56	1.75
9	600030	中信证券	7,028,573	93,901,735.28	1.66
10	600519	贵州茅台	423,851	88,593,336.02	1.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(http://www.dcfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

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	600036	招商银行	30,933,429.75	0.57
2	600011	华能国际	28,354,633.89	0.52
3	601939	建设银行	24,794,778.78	0.45
4	600104	上汽集团	22,756,915.31	0.42
5	000629	攀钢钒钛	19,836,147.00	0.36
6	000776	广发证券	18,768,265.28	0.34
7	601669	中国水电	18,029,456.90	0.33
8	000725	京东方A	16,905,473.46	0.31
9	601901	方正证券	14,674,755.98	0.27
10	000581	威孚高科	14,493,160.93	0.27
11	002241	歌尔声学	13,126,595.27	0.24
12	601377	兴业证券	12,997,301.57	0.24
13	600315	上海家化	12,978,480.54	0.24
14	002081	金 螳 螂	12,477,045.91	0.23
15	601991	大唐发电	12,129,359.43	0.22
16	600252	中恒集团	10,415,324.73	0.19
17	601992	金隅股份	9,651,784.38	0.18
18	600827	友谊股份	9,312,484.23	0.17
19	002353	杰瑞股份	9,179,397.91	0.17
20	600160	巨化股份	8,827,786.04	0.16

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：人民币元

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	601328	交通银行	35,834,791.35	0.66
2	600016	民生银行	25,221,341.00	0.46
3	601318	中国平安	22,506,580.68	0.41
4	601166	兴业银行	17,959,116.60	0.33
5	600000	浦发银行	17,074,862.84	0.31
6	600519	贵州茅台	14,249,030.12	0.26
7	601088	中国神华	14,005,036.26	0.26
8	600837	海通证券	13,845,694.05	0.25
9	600030	中信证券	13,526,089.06	0.25
10	600036	招商银行	12,404,272.26	0.23
11	601919	中国远洋	11,987,379.52	0.22
12	601601	中国太保	10,831,531.14	0.20
13	601727	上海电气	10,710,014.96	0.20
14	601398	工商银行	10,430,825.49	0.19
15	000858	五 粮 液	10,420,742.89	0.19
16	601991	大唐发电	9,365,571.04	0.17
17	000002	万 科A	9,213,611.39	0.17
18	601857	中国石油	8,702,185.80	0.16
19	601668	中国建筑	7,929,906.03	0.15
20	600111	包钢稀土	7,523,756.12	0.14

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	672,477,229.23
卖出股票收入（成交）总额	994,482,288.41

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	72,961.11
5	应收申购款	526,127.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	849,088.46

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	110,098,771.92	1.94	重大事项停牌

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
354,560	20,428.12	843,382,008.45	11.64%	6,399,612,672.75	88.36%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	497,258.39	0.007%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间:0至10万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间:0。

§10 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	7,563,636,558.17
本报告期基金总申购份额	741,979,252.24
减:本报告期基金总赎回份额	1,062,621,129.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,242,994,681.20

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内没有涉及本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 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，本年度支付的审计费用为15万元整。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	3	387,897,572.06	23.36%	323,254.34	22.59%	-
银河证券	3	328,910,472.85	19.80%	299,437.54	20.92%	-
国信证券	1	315,647,060.03	19.01%	268,298.56	18.75%	-
西部证券	1	215,205,783.84	12.96%	183,178.52	12.80%	-
中信建投	3	212,244,276.59	12.78%	185,289.66	12.95%	-
光大证券	2	99,553,787.58	5.99%	85,771.06	5.99%	-
兴业证券	2	91,201,502.49	5.49%	77,293.34	5.40%	-
申银万国	1	10,137,251.44	0.61%	8,616.74	0.60%	-
上海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
齐鲁证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
南京证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
北京高华	1	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
宏源证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
安信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
海通证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东北证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

（二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；

（三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；

（四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：中信建投。本报告期内退租交易单元：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

大成基金管理有限公司
2013年3月26日