大成标普500等权重指数证券投资基金

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月25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。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，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	大成标普500 等权重指数QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月23日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	97,408,937.82份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	唐州徽
	联系电话	0755-83183388	010-66594855
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-

2.5 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1号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

§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3月23日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	79,108.71	-1,161,876.30
本期利润	17,108,874.66	-18,182,616.98
加权平均基金份额本期利润	0.1341	-0.0749
本期基金份额净值增长率	13.82%	-11.70%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0162	-0.1174
期末基金资产净值	97,933,873.07	132,794,617.01
期末基金份额净值	1.005	0.883

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。

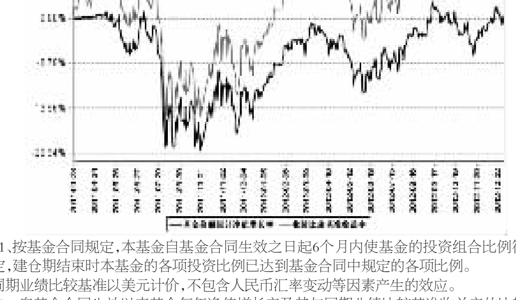
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	0.80%	0.75%	2.82%	0.79%	-2.02%	-0.04%
过去六个月	6.24%	0.76%	8.86%	0.81%	-2.62%	-0.05%
过去一年	13.82%	0.82%	17.65%	0.89%	-3.83%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.50%	1.26%	12.78%	1.36%	-12.28%	-0.10%

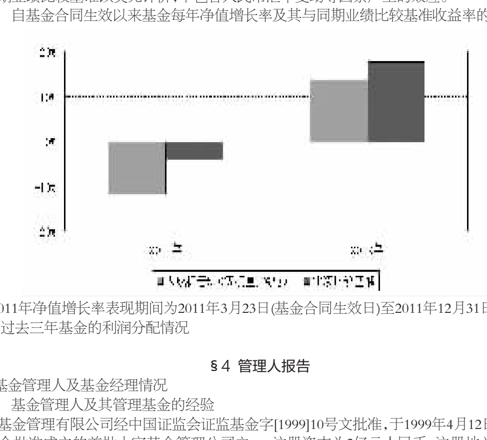
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：2011年净值增长率表现期间为2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	9年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员；2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日开始担任大成标普500等权重指数型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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 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》、《大成标普500等权重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，大成标普500等权重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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年度，国际金融形势和国际宏观经济状况都呈现逐步改善的局势，因此主要国际股票市场指数也有较大幅度的上涨。

从欧洲方面来看，欧洲各国政府及欧洲央行高度重视欧债危机带来的严重后果，采取了各类措施来尽量控制与缓解欧债危机的恶化程度，因此2012年欧洲主权债务危机有所缓解。具体来看，一方面，希腊、西班牙及意大利等多个陷入财政困境的国家均采取了程度各异的财政紧缩政策以恢复市场信心；另一方面，以欧洲央行为主导的众多国际金融组织采取了多项救助政策，尤其是欧洲央行的LTRO政策卓有成效，同时欧洲央行也将利率下调至历史低位。上述这些措施使得欧洲金融系统的紧张局面暂时得到缓解，意大利、西班牙等国的政府债券收益率水平出现显著下降，欧洲主权债务危机有所缓解。然而，尽管欧洲金融系统暂时得以稳定，但欧洲宏观经济仍然呈现小幅衰退的局势。

在2012年，美国的宏观经济及金融体系的状况显著好于欧洲。由于在2007年美国金融危机过后，美国的金融机构、工商企业及居民部门快速的调整各自的资产负债表，及至2012年美国各经济主体的资产负债表已经较为健康。因此，美国宏观经济在2012年逐步走强。

本年度美国经济复苏的显著特征是全面性及持续性，劳动力市场逐步改善、房地产市场显著回暖、制造业恢复增长、个人收入及消费支出也持续增长。虽然在4季度，美国曾经面临过财政悬崖的问题，但最后依然得到了解决。在上述多重因素的推动下，美国2012年的宏观经济都有较好的表现，而标普指数成分股的盈利也持续增长。

受到美国宏观经济及企业盈利持续增长的推动，在本报告期内，本基金的目标指数上涨17.65%，美元兑人民币中间价下跌0.24%，本基金净值上涨13.82%，低于经汇率调整后的目标指数3.55% 。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.10%，日均偏差绝对值为0.055%，均显著低于本基金合同中的目标值。

4.5.2 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1.005元，本报告期基金份额净值增长率为13.82%同期业绩比较基准收益率为17.65%，低于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年，全球宏观经济有望保持持续增长。从欧洲来看，欧元区重新爆发较大金融风险的可能性相对较小，或许某些国家的政治经济局势还会发生一定的变动并有可能会给欧洲金融市场造成一定的波动，但是综合来看，欧洲的金融局势正在逐渐变好。

展望2013年，美国宏观经济有望继续保持增长。主要经济增长点依然大概在以下几个方面：（1）美国居民收入及消费支出继续增加；（2）美国房地产市场持续复苏；（3）美国制造业活动稳步扩张。由于核心通胀率仍保持较低的水平，美联储的量化宽松政策仍会保持，这也有望对实体经济及金融市场都产生一定程度的正面影响。但是，美国经济也面临一定的风险。首先，美国政府需要逐步减少财政支出，这会对经济造成小幅的负面影响。其次，美国政府还要面对重新核定债务上限的任务，其过程如果比较曲折，则将会给资本市场带来波动。当然，即使有这些不利因素存在，考虑到强劲的私人经济的增长，美国宏观经济仍然有望保持稳定的增长。而美国宏观经济的增长有望推动企业盈利的持续增加。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，继续深入研究更为高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好的跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对大成标普500等权重指数证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，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：大成标普500等权重指数证券投资基金

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	8,454,928.95	8,206,414.51
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	92,182,351.63	125,728,789.60
其中：股票投资	92,182,351.63	125,728,789.60
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	-	363,326.40
应收利息	295.32	746.12
应收股利	103,766.75	191,040.70
应收申购款	58,859.69	156,946.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	100,800,202.34	134,647,263.61
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	1,405,774.08	-
应付赎回款	1,181,414.49	1,485,945.78
应付管理人报酬	83,679.53	113,815.16
应付托管费	20,919.88	28,453.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,541.29	224,431.88
负债合计	2,866,329.27	1,852,646.60
所有者权益：		
实收基金	97,408,937.82	150,455,310.00
未分配利润	524,935.25	-17,660,692.99
所有者权益合计	97,933,873.07	132,794,617.01
负债和所有者权益总计	100,800,202.34	134,647,263.61

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.005元，基金份额总额97,408,937.82份。

7.2 利润表

会计主体：大成标普500等权重指数证券投资基金

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3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入	19,324,840.40	-15,583,925.99
1.利息收入	22,478.56	2,356,005.74
其中：存款利息收入	22,478.56	2,356,005.74
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）	2,578,876.50	-1,428,430.28
其中：股票投资收益	344,684.84	-3,051,515.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,234,191.66	1,623,084.79
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	17,029,765.95	-17,020,740.68
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-390,097.17	-350,624.56
5.其他收入（损失以"-"号填列）	83,816.56	859,863.79
减：二、费用	2,215,965.74	2,598,690.99
1.管理人报酬	1,227,941.12	1,795,790.15
2.托管费	306,985.23	448,947.57
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	28,959.07	81,077.81
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	652,080.32	272,875.46
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	17,108,874.66	-18,182,616.98
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	17,108,874.66	-18,182,616.98

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普500等权重指数证券投资基金

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）	150,455,310.00	-17,660,692.99	132,794,617.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		17,108,874.66	17,108,874.66
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）	-53,046,372.18	1,076,753.58	-51,969,618.60
其中：1.基金申购款	39,428,510.24	-1,242,486.30	38,186,023.94
2.基金赎回款	-92,474,882.42	2,319,239.88	-90,155,642.54
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）	97,408,937.82	524,935.25	97,933,873.07

项目	上年度可比期间 2011年3月23日(基金合同生效日)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）	822,754,222.26	-	822,754,222.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,182,616.98	-18,182,616.98
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）	-672,298,912.26	521,923.99	-671,776,988.27
其中：1.基金申购款	18,385,817.26	-2,373,174.11	16,012,643.15
2.基金赎回款	-690,684,729.52	2,895,098.10	-687,789,631.42
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）	150,455,310.00	-17,660,692.99	132,794,617.01

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：

王颢 刘彩晖 范瑛

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)股份有限公司（"中银香港"）	境外资产托管人
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. 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。

2. 下述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

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,227,941.12	1,795,790.15
其中：支付销售机构的客户维护费	517,003.24	724,423.62

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

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3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	306,985.23	448,947.57

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

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

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

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3月23日(基金合同生效日)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
中银香港	7,091,534.17	-	4,819,234.42	-
中国银行	1,363,394.78	22,377.78	3,387,180.09	2,355,960.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

§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	92,182,351.63	91.45
	其中：普通股票	92,182,351.63	91.45
	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	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
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	8,454,928.95	8.39
8	其他各项资产	162,921.76	0.16
9	合计	100,800,202.34	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	92,182,351.63	94.13
合计	92,182,351.63	94.13

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	15,141,144.93	15.46
消费者非必需品	15,127,333.36	15.45
信息技术	12,858,780.44	13.13
工业	11,215,616.37	11.45
医疗保健	9,556,713.47	9.76
能源	7,831,663.39	8.00
消费者常用品	7,640,770.60	7.80
基础材料	5,689,108.00	5.81
公用事业	5,678,197.24	5.80
电信服务	1,443,023.83	1.47
合计	92,182,351.63	94.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所集团	NYX UN	纽约交易所	US	1,235	244,832.17	0.25
2	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	US	2,632	214,237.50	0.22
3	FLIR Systems Inc	FLIR系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	1,493	209,362.65	0.21
4	Mead-Westvaco Corp	MeadWestvaco公司	MWV UN	纽约交易所	US	1,021	204,525.58	0.21
5	Cliffs Natural Resources Inc	克里夫斯自然资源股份有限公司	CLF UN	纽约交易所	US	843	204,316.97	0.21
6	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	653	204,154.42	0.21
7	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	US	1,839	202,398.69	0.21
8	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	US	2,329	202,163.62	0.21
9	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	640	201,779.64	0.21
10	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	2,761	201,309.48	0.21

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。

8.4.1 积极投资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益投资明细

无。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Fossil Inc	FOSL UQ	313,282.67	0.24
2	Monster Beverage Corp	MNST UQ	290,880.48	0.22
3	Crown Castle Intl Corp	CCI UN	265,235.27	0.20
4	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	229,242.08	0.17
5	WPX Energy Inc.	WPX UN	227,113.08	0.17
6	PETsMART Inc	PETM UQ	224,380.67	0.17
7	Ensco PLC - CL A	ESV UN	220,297.02	0.17
8	LyondellBasell Industries N.V.	LYB UN	219,757.64	0.17
9	Seagate Technology	STX UQ	219,679.41	0.17
10	First Solar Inc	FSLR UQ	211,423.67	0.16
11	Advanced Micro Devices	AMD UN	199,961.02	0.15
12	Apollo Group Inc	APOL UQ	198,045.32	0.15
13	Alpha Natural Resources	ANR UN	196,657.00	0.15
14	Dollar General Corp	DG UN	186,767.69	0.14
15	Delphi Automotive PLC	DLPH UN	185,445.17	0.14
16	Garmin Ltd	GRMN UQ	178,649.09	0.13
17	Phillips 66	PSX UN	172,423.43	0.13
18	Pentair Ltd.	PNR UN	172,212.62	0.13
19	The ADT Corp.	ADT UN	144,048.25	0.11
20	Allegheny Technologies Inc	ATI UN	143,089.56	0.11

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

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Sears Holdings Corp	SHLD UQ	423,136.43	0.32
2	Pulte Group Inc	PHM UN	419,645.89	0.32
3	Sunoco Inc	SUN UN	391,616.62	0.29
4	Sprint Nextel Corp	S UN	344,896.84	0.26
5	Tenet Healthcare	THC UN	335,906.69	0.25
6	Titanium Metals Corp	TIE UN	334,390.78	0.25
7	Duke Energy Corp	DUK UN	331,890.36	0.25
8	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	331,506.71	0.25
9	Tesoro Corp	TSO UN	329,004.73	0.25
10	NetFlix Inc	NFLX UQ	321,629.22	0.24
11	Whirlpool Corp	WHR UN	321,051.77	0.24
12	First Solar Inc	FSLR UQ	319,441.84	0.24
13	Expedia	EXPE UQ	307,436.62	0.23
14	Bank of America Corp	BAC UN	280,978.02	0.21
15	Constellation Brands Inc A	STZ UN	274,305.99	0.21
16	Metropcs Communications Inc	PCS UN	271,813.92	0.20
17	Lennar Corp	LEN UN	271,487.82	0.20
18	Lexmark International Inc	LXK UN	270,587.93	0.20
19	Sara Lee Corp	SLE UN	269,016.14	0.20
20	Motorola Mobility Holdings, Inc	MMI UN	267,272.33	0.20

注：本项中"本期累计卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	18,559,437.01
卖出收入（成交）总额	69,266,317.05

注：本项中"买入股票的成本(成交)总额"及"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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股票。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	103,766.75
4	应收利息	295.32
5	应收申购款	58,859.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,921.76

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.11.6 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
5,337	18,251.63	1,308,406.03	1.34%	96,100,531.79	98.66%

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	44,468.40	0.05%

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该只基金份额总量的数量区间：0。

2、本基金的基金经理持有该只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（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	150,455,310.00
本报告期基金总申购份额	39,428,510.24
减：本报告期基金总赎回份额	92,474,882.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	97,408,937.82

§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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

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普华永道中天会计师事务所有限公司，本年度支付的审计费用为7.2万元整。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	
高盛证券	1	35,192,750.53	40.07%	10,557.55	38.51%	-
摩根士丹利	1	27,556,053.76	31.38%	8,189.98	29.88%	-
美林证券	1	13,335,756.59	15.18%	5,142.42	18.76%	-
野村证券	1	11,113,263.11	12.65%	3,333.76	12.16%	-
花旗银行	1	627,930.07	0.71%	188.45	0.69%	-

注：1、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，本公司制定了租用境内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。

2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

（一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；

（二）资历雄厚，信誉良好；

（三）财务状况良好，经营行为规范；

（四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；

（五）证券研究或市场研究实力突出，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；

（六）具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

（七）具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

（八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

（九）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。

交易管理部在每季初5个交易日内，汇总上季度境外券商综合服务评价结果，作为本季度境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，交交易员在交易时进行券商选择。公司通过一家境外券商买卖证券的年交易佣金，不得超过公司当年所有境外投资组合通过境外券商买卖证券交易佣金的30%。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括：长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、光大证券、申银万国、中银国际、东莞证券、渤海证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券、天源证券、广发证券、西南证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金退租的境内交易单元：中邮证券，新增境内交易单元：广发证券、西南证券。新增境外交易单元：花旗银行。

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