



信息披露

2013年8月29日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B161

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

监督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后续工作。

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相一致,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,由估值委员会讨论决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环节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 管理人定期对基金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。

5.6 持有人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况说明
在托管人深证成长40交易型开放式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》及相关法规的规定以及《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定,对深证成长40交易型开放式指数证券投资基金管理人—大成基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算并妥善保管了相关履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金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
本基金管理人认为,大成基金管理有限公司在深证成长40交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的价格的计价、基金费用开支等方面,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》等相关法律法规,在各重要方面运作符合相关法律法规的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息真实、准确和完整发表意见
本基金管理人认为,大成基金管理有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要求,基金管理人编制和披露的深证成长40交易型开放式指数证券投资基金半年度报告中的财务信息、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关基金持有人利益的行为。

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
单位:人民币元
报告截止日:2013年6月30日

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	33,291,122.43	19,983,242.77
结算备付金	109,270.32	1,062,499.10
存出保证金	35,261.66	969,073.03
交易性金融资产	1,259,666,657.72	1,353,387,463.02
其中:股票投资	1,259,666,657.72	1,353,387,463.02
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	-	57,898,253.42
应收利息	5,507.33	2,856.44
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,293,107,819.46	1,433,753,387.80
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	559,398.81	542,171.22
应付托管费	111,879.75	108,434.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	206,234.31	304,706.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	348,388.74	1,138,442.87
负债合计	118,783,433.61	2,120,168.71
所有者权益:		
实收基金	1,826,639,725.00	1,961,639,725.00
未分配利润	-545,410,339.18	-530,006,502.91
所有者权益合计	1,281,229,385.82	1,431,633,222.09
所有者权益总计	1,293,107,819.46	1,433,753,387.80

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.所述基金净值指标不包括持有认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

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
过去一个月	-11.71%	1.75%	-12.61%	1.81%	0.90%	-0.06%
过去三个月	-3.84%	1.41%	-4.53%	1.44%	0.69%	-0.03%
过去六个月	-3.97%	1.34%	-4.76%	1.37%	0.79%	-0.03%
过去一年	-8.84%	1.30%	-9.91%	1.32%	1.07%	-0.02%
自基金合同生效以来至今	-29.90%	1.26%	-32.81%	1.31%	2.91%	-0.05%

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

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-45,041,112.79	99,950,270.71
1.利息收入	82,429.28	63,675.26
其中:存款利息收入	82,429.28	63,675.26
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)	-60,314,281.63	-97,039,301.42
其中:股票投资收益	-72,555,268.84	-105,847,485.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	12,240,987.21	8,808,184.50
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	15,191,594.90	196,924,691.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-855.34	1,205.51
减:一、费用	5,274,209.43	5,768,309.03
1.管理人报酬	3,463,249.58	3,861,259.66
2.托管费	692,649.90	772,250.12
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	667,996.10	660,057.71
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	404,323.85	474,752.54
三、净利润(亏损)总额	-50,315,322.22	94,181,961.68
减:所得税费用	-	-
四、净利润(亏损)总额	-50,315,322.22	94,181,961.68

注:1.报告期自2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额1,826,639,725.00份。
6.2 利润表
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-45,041,112.79	99,950,270.71
1.利息收入	82,429.28	63,675.26
其中:存款利息收入	82,429.28	63,675.26
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)	-60,314,281.63	-97,039,301.42
其中:股票投资收益	-72,555,268.84	-105,847,485.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	12,240,987.21	8,808,184.50
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	15,191,594.90	196,924,691.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-855.34	1,205.51
减:一、费用	5,274,209.43	5,768,309.03
1.管理人报酬	3,463,249.58	3,861,259.66
2.托管费	692,649.90	772,250.12
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	667,996.10	660,057.71
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	404,323.85	474,752.54
三、净利润(亏损)总额	-50,315,322.22	94,181,961.68
减:所得税费用	-	-
四、净利润(亏损)总额	-50,315,322.22	94,181,961.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动情况
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,961,639,725.00	-530,006,502.91
二、本期投资产生的基金净值变动(本期利润)	-50,315,322.22	-50,315,322.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等产生的基金净值变动)	-135,000,000.00	-100,008,511.05
其中:1.基金申购款	130,000,000.00	-31,635,004.72
2.基金赎回款	-265,000,000.00	66,546,493.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等产生的基金净值变动)	-135,000,000.00	-100,008,511.05
其中:1.基金申购款	76,000,000.00	-17,475,209.97
2.基金赎回款	-210,000,000.00	49,513,815.94
四、本期所有所有者权益(基金净值)	1,826,639,725.00	-545,410,339.18
五、期末所有者权益(基金净值)	1,826,639,725.00	-545,410,339.18

注:1.报告期自2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额1,826,639,725.00份。
6.4 现金流量表
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、经营活动产生的现金流量	1,293,107,819.46	1,433,753,387.80
1.销售商品、提供劳务收到的现金	1,293,107,819.46	1,433,753,387.80
2.收到的税费返还	-	-
3.收到的其他与经营活动有关的现金	-	-
二、投资活动产生的现金流量	-	-
1.购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	-	-
2.权益性投资支付的现金	-	-
3.债权性投资支付的现金	-	-
4.支付的其他与投资活动有关的现金	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
1.吸收投资收到的现金	-	-
2.发行债券收到的现金	-	-
3.收到的其他与筹资活动有关的现金	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	1,293,107,819.46	1,433,753,387.80

注:1.报告期自2013年6月30日,基金份额净值0.701元,基金份额总额1,826,639,725.00份。
6.5 资产负债表日后事项
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

6.6 关联方关系
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中国证券监督管理委员会	基金监管人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金销售人
中国银河证券股份有限公司	基金销售人
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	基金销售人
大成基金旗下基金	基金管理人管理的基金

注:1.中国证监于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并暂停其全国行政处罚。
6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
成交金额	465,284,460.39	-
占当期股票成交总额的比例	100.00%	-
成交金额	-	0.00%
占当期股票成交总额的比例	-	0.00%

6.4.4.1.2 权证交易
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期佣金	411,731.24	100.00%
占当期佣金总额的比例	100.00%	100.00%
期末应付佣金余额	206,233.06	-
占期末应付佣金总额的比例	100.00%	-

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.该券商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。

6.4.4.2 基金关联方
6.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金支付的管理费	3,463,249.58	3,861,259.66
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-
日管理费=前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数	-	-

6.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金支付的管理费	692,649.90	772,250.12
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-
日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数	-	-

注:1.上述托管费按基金资产净值0.10%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 0.10% / 当年天数

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
6.4.4.3.1 报告期间内及上年度可比期间内与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.3.2 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.3 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

关联方名称	持有的基金份额 2013年6月30日	持有的基金份额比例 2013年6月30日	持有的基金份额 2012年12月31日	持有的基金份额比例 2012年12月31日
大成深证成长	1,779,500,000.00	97.42%	1,792,500,000.00	91.38%

6.4.4.3.4 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
报告主体:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

关联方名称	持有的基金份额 2013年6月30日	持有的基金份额比例 2013年6月30日	持有的基金份额 2012年12月31日	持有的基金份额比例 2012年12月31日
大成深证成长	1,779,500,000.00	97.42%	1,792,500,000.00	91.38%

6.4.4.3.5 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.6 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.7 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.8 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.9 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.10 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.11 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.12 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.13 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.14 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.15 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.16 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.17 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.18 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.19 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.20 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.21 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.22 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.23 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.24 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.25 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.26 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.27 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.28 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.29 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.30 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.31 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.32 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.33 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.34 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.35 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.36 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.37 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.38 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.39 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.40 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.41 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.42 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.43 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.44 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.45 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.46 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.47 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.48 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.49 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.50 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.51 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.52 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.53 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.54 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.55 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.56 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.57 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.58 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.59 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.60 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.61 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.62 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.63 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.64 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.65 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.66 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.67 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.68 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.69 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.70 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.3.71 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.3.72 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况