

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8月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会在报告书中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带的法律责任。本公司年度报告在百分之五以上独立董事签字同意，并董事长签发。

本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8月26日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告等内容,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摘要。

本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告出自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 大成深证成长40ETF

基金主代码 159906

交易代码 159906

基金运作方式 灵活配置型开放式

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

报告期基金总资产 1,826,639,725.00元

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为“深成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数,寻求与标的指数相似的投资回报。

本基金主要采取指数化投资策略,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期标的指数的成分股构成、权重分布和行业特征发生变化时,基金管理人将适时对投资组合进行相应的调整,以使投资组合更加紧密地跟踪标的指数。

投资策略 本基金通过深入研究宏观经济、政策环境、产业结构、行业趋势、公司基本面、技术面、资金面等多方面的因素,结合对标的指数成分股的分析,在严格遵守基金合同规定的投资限制的前提下,通过积极主动的资产配置,力求在有效控制风险的前提下,力争取得超越标的指数的收益。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

基金管理人严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定,履行了作为基金管理人的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

5.2 托管人报告

基金管理人对本报告期内本基金托管人履行职责情况、准确性和完整性发表意见,认为其履行了基金管理人的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

5.3 托管人报告本年度报告中财务信息的内容真实、准确和完整无误。

5.4 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.5 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.6 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.7 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.8 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.9 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.10 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.11 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.12 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.13 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.14 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.15 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.16 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.17 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.18 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.19 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.20 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.21 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.22 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.23 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.24 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.25 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.26 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.27 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.28 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.29 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.30 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.31 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.32 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.33 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.34 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.35 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.36 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.37 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.38 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.39 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.40 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.41 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.42 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.43 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.44 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.45 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.46 托管人报告本年度报告中基金投资运作情况的说明

基金管理人认为,本基金托管人完全履行了基金合同规定的各项责任,对基金财产的投资运作、基金资产的保管、基金费用的计提和支付、基金收益的分配等进行了认真、完整的核对,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。