

大成沪深 300 指数证券投资基金
2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 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：2012 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	26
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 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	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	36
7.8 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	36
7.9 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
§ 9 开放式基金份额变动	38

§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4 基金投资策略的改变	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
10.8 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	40
§ 12 备查文件目录	40
12.1 备查文件目录	40
12.2 存放地点	41
12.3 查阅方式	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成沪深 300 指数证券投资基金
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	7,300,022,155.63 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
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张树忠	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街27号投资广场23层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-206,684,566.65
本期利润	303,403,496.19
加权平均基金份额本期利润	0.0408
本期加权平均净值利润率	5.23%
本期基金份额净值增长率	5.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-1,757,890,001.86
期末可供分配基金份额利润	-0.2408
期末基金资产净值	5,542,132,153.77
期末基金份额净值	0.7592
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	84.68%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）

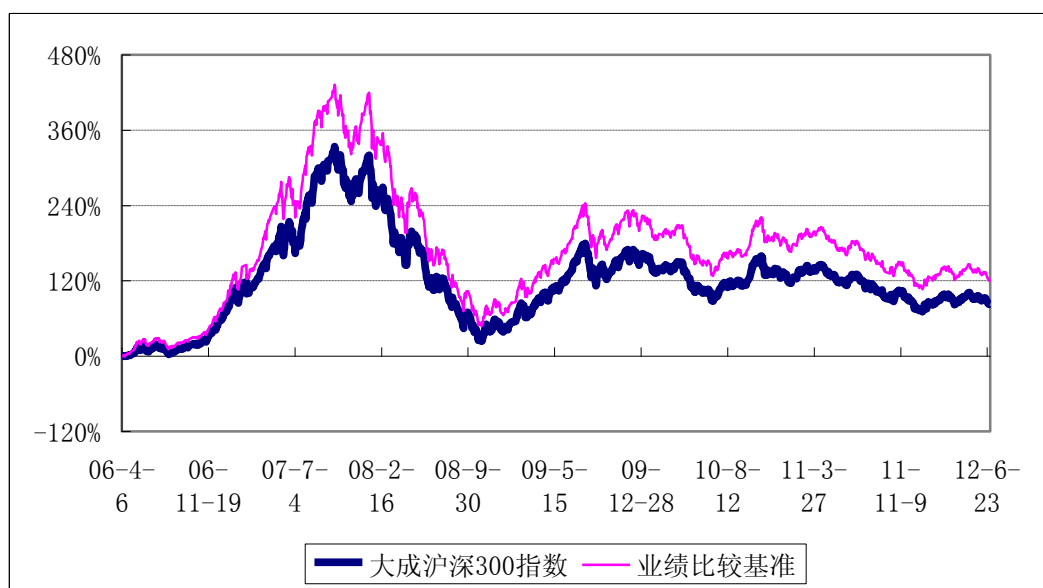
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	-5.44%	1.02%	-6.48%	1.09%	1.04%	-0.07%
过去三个月	0.96%	1.05%	0.27%	1.12%	0.69%	-0.07%
过去六个月	5.37%	1.25%	4.94%	1.33%	0.43%	-0.08%
过去一年	-17.73%	1.27%	-19.13%	1.35%	1.40%	-0.08%
过去三年	-21.94%	1.48%	-22.26%	1.57%	0.32%	-0.09%
自基金合同生效起至今	84.68%	1.94%	123.13%	2.04%	-38.45%	-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。

§ 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6月30

日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金，1 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF 及大成深证成长 40ETF 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 21 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。

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	-	8 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 日开始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 日开始兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2011 年 11 月 8 日开始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。

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 公平交易制度的执行情况

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，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2012 年上半年，公司旗下主动投资组合间股票交易存在两笔同日反向交易，与市场成交情况比较，两笔交易成交均价与市场均价不存在明显差异，且同日反向交易成交较少的单边交易量占该股当日市场成交量比例均低于 1%。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，其中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 3 次，原因是指数型投资组合投资策略需要；投资组合间存在债券同日反向交易，但投资组合间的交易价格比较一致，与市场成交均价较为接近，且各投资组合成交量占市场成交量比例不足 5%，基于此公司认为，投资组合间债券的同日反向交易不存在异常交易行为；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；而投资组合间虽然存在同向交易行为，但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，投资组合间不存在利益输送的可能性。

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

在去房地产化政策作用下，上半年中国经济增速整体出现了明显的回落。与此同时，货币政策开始放松，人民币升值趋势告一段落。市场层面，指数不断下行，但以医药、酒类为代表的消费板块走出了逆市上涨行情，一定程度上契合了中国经济结构转型的大方向。站在消费板块对面的是低估值银行板块。尽管其估值已经非常低，但股价走势依旧我行我素的疲软，充分反映了市场对经济整体的担忧。银行股和消费类股票估值重塑的二级分化反映了市场对中国经济转型中的危与机的深刻预期。这种预期的形成不是一个短期效应，很可能会潜移默化地在未来相当长的一段时间对市场发生作用。而未来证券市场最有可能产生的向上推力来源于证券市场自身的金融创新和制度变革。

在运作期内，本基金较好地跟踪了沪深 300 指数，截止 2012 年中期，基金年化跟踪误差 1.35%，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 0.7592 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.37%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%，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

未来中国的经济增长步入新阶段是大概率事件。估计三季度宏观调控政策会进一步放松，但通过业绩提升来改善上市公司整体估值的可能性不大。未来上市公司的竞争环境正在发生深刻变化，上市公司面对的将由以往扩张下的成长机会转向收缩下的发展机会，上市公司发展模式也势必将由向外看，转为向内看。公司治理良好、管理水平优秀的上市公司将获得更多的资金青睐。市场经过第二季度的下跌，三季度出现反弹的可能性在增加。反观今年以来，虽然指数出现了系统性的下跌，但股价创新高的个股也不少。市场仍存在结构性的投资机会，而这一特点有望贯穿今年全年。

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 6 月 30 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合规守信、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 托管人对本半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 指数证券投资基金半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	390,471,009.60	312,247,924.49
结算备付金		-	78,261.46
存出保证金		399,546.70	332,069.04
交易性金融资产	6.4.2.2	5,186,947,964.93	5,094,889,169.09
其中：股票投资		5,186,947,964.93	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	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		-	47,755,925.58
应收利息	6.4.2.5	67,783.66	62,975.92
应收股利		10,614,881.90	-
应收申购款		1,430,664.93	354,445.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		5,589,931,851.72	5,455,720,771.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 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	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		41,560,180.62	-
应付赎回款		913,398.33	478,465.26
应付管理人报酬		3,498,002.29	3,591,956.93
应付托管费		699,600.43	718,391.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	666,598.70	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	6.4.2.8	461,917.58	671,607.50
负债合计		47,799,697.95	5,830,455.15
所有者权益:			
实收基金	6.4.2.9	7,300,022,155.63	7,563,636,558.17
未分配利润	6.4.2.10	-1,757,890,001.86	-2,113,746,242.32
所有者权益合计		5,542,132,153.77	5,449,890,315.85
负债和所有者权益总计		5,589,931,851.72	5,455,720,771.00

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7592 元，基金份额总额 7,300,022,155.63 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		331,489,455.73	-47,894,992.35
1. 利息收入		1,287,185.11	1,683,336.21
其中：存款利息收入	6.4.2.11	1,287,185.11	1,651,834.14
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）		-180,118,724.66	24,096,955.66
其中：股票投资收益	6.4.2.12	-242,968,232.42	-39,401,649.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	-	2,234,029.66

资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.2.14	-	-
股利收益	6.4.2.15	62,849,507.76	61,264,575.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.16	510,088,062.84	-76,178,254.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.17	232,932.44	2,502,969.81
减：二、费用		28,085,959.54	43,309,031.55
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	21,622,033.19	29,455,249.56
2. 托管费	6.4.5.2.2	4,324,406.63	5,891,049.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.18	1,919,410.06	7,739,651.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.2.19	220,109.66	223,080.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		303,403,496.19	-91,204,023.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		303,403,496.19	-91,204,023.90

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	-	303,403,496.19	303,403,496.19
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）	-263,614,402.54	52,452,744.27	-211,161,658.27
其中：1. 基金申购款	366,716,165.60	-81,505,306.02	285,210,859.58
2. 基金赎回款	-630,330,568.14	133,958,050.29	-496,372,517.85
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）	7,300,022,155.63	-1,757,890,001.86	5,542,132,153.77
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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）	-	-91,204,023.90	-91,204,023.90
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）	-1,166,455,094.77	-20,521,611.06	-1,186,976,705.83
其中：1. 基金申购款	1,322,247,389.60	-69,791,888.20	1,252,455,501.40
2. 基金赎回款	-2,488,702,484.37	49,270,277.14	-2,439,432,207.23
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）	7,872,232,728.74	-607,413,664.90	7,264,819,063.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项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、会计估计税项与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	390,471,009.60
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	390,471,009.60

6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,238,773,344.43	5,186,947,964.93	-1,051,825,379.50
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,238,773,344.43	5,186,947,964.93	-1,051,825,379.50

6.4.2.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.2.4 买入返售金融资产

6.4.2.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.2.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	67,783.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	67,783.66

6.4.2.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	666,598.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	666,598.70

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	828.22
应付后端申购费	2,237.08
预提信息披露费	149,179.94
预提审计费	59,672.34
合计	461,917.58

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,563,636,558.17	7,563,636,558.17
本期申购	366,716,165.60	366,716,165.60
本期赎回(以“-”号填列)	-630,330,568.14	-630,330,568.14
本期末	7,300,022,155.63	7,300,022,155.63

6.4.2.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	612,274,318.31	-2,726,020,560.63	-2,113,746,242.32
本期利润	-206,684,566.65	510,088,062.84	303,403,496.19
本期基金份额交易产生的变动数	-16,515,378.12	68,968,122.39	52,452,744.27
其中：基金申购款	22,622,812.06	-104,128,118.08	-81,505,306.02
基金赎回款	-39,138,190.18	173,096,240.47	133,958,050.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	389,074,373.54	-2,146,964,375.40	-1,757,890,001.86

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	1,280,940.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,139.23
其他	105.09
合计	1,287,185.11

6.4.2.12 股票投资收益

6.4.2.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	684,154,593.35
减：卖出股票成本总额	927,122,825.77
买卖股票差价收入	-242,968,232.42

6.4.2.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资产生的收益/损失。

6.4.2.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.2.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	62,849,507.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	62,849,507.76

6.4.2.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	510,088,062.84
——股票投资	510,088,062.84
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	510,088,062.84

6.4.2.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	232,932.44
合计	232,932.44

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.2.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	1,919,410.06
银行间市场交易费用	-
合计	1,919,410.06

6.4.2.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	149,179.94
银行费用	2,257.38
债券帐户维护费	9,000.00
合计	220,109.66

6.4.2.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	80,518,599.48	6.78%	361,511,804.55	7.73%

6.4.5.1.2 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6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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%

6.4.5.1.3 债券回购交易

本基金本期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.5.1.4 权证交易

本基金本期内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。

6.4.5.1.5 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6月30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	68,440.87	6.82%	68,440.87	10.27%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	295,528.48	7.52%	295,528.48	12.48%

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。权证交易不计佣金。

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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	21,622,033.19
其中：支付销售机构的客户维护费	4,927,240.82	5,693,243.57

注：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：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	4,324,406.63

注：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：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.5.3 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未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 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	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30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。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30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	390,471,009.60	1,280,940.79	388,122,589.76	1,629,656.15

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。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.5.7 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。

6.4.6 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.7 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
000059	辽通化工	2012年6月26日	拟议非公开发行股票	7.91	2012年7月3日	8.15	649,965	6,880,440.03	5,141,223.15	-
002500	山西证券	2012年5月15日	筹划资产收购事项	8.19	-	-	519,805	4,769,786.40	4,257,202.95	-

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

6.4.8.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到年本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，除附注6.4.7.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票外，均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.8.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.8.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	390,471,009.60	-	-	-	-	-	390,471,009.60
存出保证金	-	-	-	-	-	399,546.70	399,546.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,186,947,964.93	5,186,947,964.93
应收利息	-	-	-	-	-	67,783.66	67,783.66
应收股利	-	-	-	-	-	10,614,881.90	10,614,881.90

应收申购款	148,856.87	-	-	-	-	1,281,808.06	1,430,664.93
资产总计	390,619,866.47	-	-	-	-	5,199,311,985.25	5,589,931,851.72
负债							
应付证券清算款						41,560,180.62	41,560,180.62
应付赎回款						913,398.33	913,398.33
应付管理人报酬						3,498,002.29	3,498,002.29
应付托管费						699,600.43	699,600.43
应付交易费用						666,598.70	666,598.70
其他负债						461,917.58	461,917.58
负债总计						47,799,697.95	47,799,697.95
利率敏感度缺口	390,619,866.47	-	-	-	-	5,151,512,287.30	5,542,132,153.77
上年度末 2011年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	312,247,924.49	-	-	-	-	-	312,247,924.49
结算备付金	78,261.46	-	-	-	-	-	78,261.46
存出保证金	-	-	-	-	-	332,069.04	332,069.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,094,889,169.09	5,094,889,169.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	47,755,925.58	47,755,925.58
应收利息	-	-	-	-	-	62,975.92	62,975.92
应收申购款	10,410.32	-	-	-	-	344,035.10	354,445.42
资产总计	312,336,596.27	-	-	-	-	5,143,384,174.73	5,455,720,771.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	478,465.26	478,465.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,591,956.93	3,591,956.93
应付托管费	-	-	-	-	-	718,391.37	718,391.37
应付交易费用	-	-	-	-	-	370,034.09	370,034.09
其他负债	-	-	-	-	-	671,607.50	671,607.50
负债总计	-	-	-	-	-	5,830,455.15	5,830,455.15
利率敏感度缺口	312,336,596.27	-	-	-	-	5,137,553,719.58	5,449,890,315.85

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于2012年6月30日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对2012年6月30日基金资产净值不产生影响；本基金于2011年12月31日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对2011年末基金资产净值亦无重大影响。

6.4.8.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.8.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金跟踪标的指数的投资组合的资产原则上不低于基金资产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2012 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,186,947,964.93	93.59	5,094,889,169.09	93.49
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	5,186,947,964.93	93.59	5,094,889,169.09	93.49

6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	260,470,000.00	256,600,601.38
沪深 300 指数下降 5%	-260,470,000.00	-256,600,601.38	

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	5,186,947,964.93	92.79
	其中：股票	5,186,947,964.93	92.79
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	390,471,009.60	6.99
6	其他各项资产	12,512,877.19	0.22
7	合计	5,589,931,851.72	100.00

7.2 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	30,691,209.31	0.55
B	采掘业	525,217,414.24	9.48
C	制造业	1,827,031,128.21	32.97
C0	食品、饮料	385,178,524.15	6.95
C1	纺织、服装、皮毛	28,714,667.52	0.52
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	113,254,901.21	2.04
C5	电子	86,164,849.87	1.55
C6	金属、非金属	422,183,562.09	7.62
C7	机械、设备、仪表	560,066,219.36	10.11
C8	医药、生物制品	229,794,206.01	4.15
C99	其他制造业	1,674,198.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	133,006,265.18	2.40
E	建筑业	172,539,099.40	3.11
F	交通运输、仓储业	137,862,472.61	2.49
G	信息技术业	150,178,725.35	2.71

H	批发和零售贸易	141,908,625.63	2.56
I	金融、保险业	1,621,574,262.77	29.26
J	房地产业	286,853,837.28	5.18
K	社会服务业	48,924,301.29	0.88
L	传播与文化产业	17,541,483.01	0.32
M	综合类	93,619,140.65	1.69
	合计	5,186,947,964.93	93.59

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	16,611,241	181,394,751.72	3.27
2	601318	中国平安	3,588,284	164,128,110.16	2.96
3	600016	民生银行	24,190,320	144,900,016.80	2.61
4	601328	交通银行	24,520,924	111,324,994.96	2.01
5	600519	贵州茅台	444,751	106,362,201.65	1.92
6	601166	兴业银行	8,085,961	104,955,773.78	1.89
7	600000	浦发银行	11,986,372	97,449,204.36	1.76
8	601939	建设银行	23,119,798	97,103,151.60	1.75
9	600030	中信证券	7,375,773	93,156,012.99	1.68
10	000002	万科A	10,367,116	92,371,003.56	1.67
11	600837	海通证券	8,666,439	83,457,807.57	1.51
12	601088	中国神华	3,532,116	79,401,967.68	1.43
13	601601	中国太保	3,366,442	74,667,683.56	1.35
14	000858	五粮液	2,032,612	66,588,369.12	1.20
15	601398	工商银行	16,665,908	65,830,336.60	1.19
16	600111	包钢稀土	1,556,266	61,410,256.36	1.11
17	601668	中国建筑	16,064,451	53,655,266.34	0.97
18	600048	保利地产	4,586,488	52,010,773.92	0.94
19	000157	中联重科	4,758,852	47,731,285.56	0.86
20	000776	广发证券	1,583,723	47,242,457.09	0.85
21	000651	格力电器	2,254,987	47,016,478.95	0.85
22	002304	洋河股份	346,938	46,680,507.90	0.84
23	601169	北京银行	4,712,090	46,037,119.30	0.83
24	600031	三一重工	3,252,827	45,279,351.84	0.82
25	601006	大秦铁路	6,368,445	44,770,168.35	0.81
26	000001	深发展A	2,743,390	41,589,792.40	0.75
27	002024	苏宁电器	4,495,254	37,715,181.06	0.68

28	600900	长江电力	5,300,756	36,045,140.80	0.65
29	600887	伊利股份	1,712,108	35,235,182.64	0.64
30	600015	华夏银行	3,667,490	34,731,130.30	0.63
31	601857	中国石油	3,801,625	34,404,706.25	0.62
32	600050	中国联通	9,079,601	33,776,115.72	0.61
33	600104	上汽集团	2,361,633	33,747,735.57	0.61
34	601899	紫金矿业	8,462,194	32,833,312.72	0.59
35	600585	海螺水泥	2,141,742	31,740,616.44	0.57
36	000568	泸州老窖	746,519	31,585,218.89	0.57
37	600383	金地集团	4,788,776	31,031,268.48	0.56
38	600256	广汇能源	2,251,668	30,329,967.96	0.55
39	000063	中兴通讯	2,106,901	29,412,337.96	0.53
40	601628	中国人寿	1,606,314	29,395,546.20	0.53
41	600999	招商证券	2,495,682	28,974,868.02	0.52
42	600028	中国石化	4,585,237	28,886,993.10	0.52
43	000983	西山煤电	1,687,076	26,318,385.60	0.47
44	600518	康美药业	1,648,119	25,413,994.98	0.46
45	600547	山东黄金	761,970	25,023,094.80	0.45
46	000069	华侨城A	3,893,586	24,841,078.68	0.45
47	601989	中国重工	4,711,741	24,453,935.79	0.44
48	000338	潍柴动力	819,798	24,339,802.62	0.44
49	600019	宝钢股份	5,625,660	24,302,851.20	0.44
50	000527	美的电器	2,174,458	24,027,760.90	0.43
51	000792	盐湖股份	681,239	23,005,441.03	0.42
52	600739	辽宁成大	1,461,445	22,798,542.00	0.41
53	600489	中金黄金	1,050,604	22,608,998.08	0.41
54	000423	东阿阿胶	560,221	22,414,442.21	0.40
55	600795	国电电力	8,243,762	22,258,157.40	0.40
56	600011	华能国际	3,304,390	21,313,315.50	0.38
57	600362	江西铜业	888,908	21,253,790.28	0.38
58	601988	中国银行	7,465,879	21,053,778.78	0.38
59	601699	潞安环能	985,694	20,443,293.56	0.37
60	600690	青岛海尔	1,725,371	20,221,348.12	0.36
61	000629	攀钢钒钛	3,066,200	20,175,596.00	0.36
62	000895	双汇发展	324,440	20,076,347.20	0.36
63	600348	阳泉煤业	1,287,710	19,701,963.00	0.36
64	601600	中国铝业	3,112,952	19,206,913.84	0.35
65	600089	特变电工	2,822,309	19,107,031.93	0.34
66	600276	恒瑞医药	662,055	19,007,599.05	0.34

67	601009	南京银行	2,225,562	18,961,788.24	0.34
68	600406	国电南瑞	1,012,212	18,918,242.28	0.34
69	601688	华泰证券	1,799,040	18,889,920.00	0.34
70	000024	招商地产	737,845	18,099,337.85	0.33
71	601299	中国北车	4,420,701	17,727,011.01	0.32
72	000538	云南白药	297,309	17,624,477.52	0.32
73	601669	中国水电	4,027,700	17,601,049.00	0.32
74	601168	西部矿业	2,041,531	17,475,505.36	0.32
75	601766	中国南车	3,784,517	17,257,397.52	0.31
76	000725	京东方A	8,945,612	17,086,118.92	0.31
77	000402	金融街	2,593,215	16,933,693.95	0.31
78	000783	长江证券	1,777,693	16,177,006.30	0.29
79	000709	河北钢铁	5,685,197	15,520,587.81	0.28
80	600309	烟台万华	1,157,934	15,458,418.90	0.28
81	601898	中煤能源	1,960,310	15,172,799.40	0.27
82	000100	TCL集团	7,260,210	14,738,226.30	0.27
83	000630	铜陵有色	760,990	14,687,107.00	0.27
84	601186	中国铁建	3,295,901	14,666,759.45	0.26
85	600068	葛洲坝	2,240,692	14,631,718.76	0.26
86	600100	同方股份	1,702,707	14,336,792.94	0.26
87	600600	青岛啤酒	372,505	14,225,965.95	0.26
88	601390	中国中铁	5,490,654	14,110,980.78	0.25
89	600642	申能股份	3,038,058	14,005,447.38	0.25
90	000878	云南铜业	758,142	13,570,741.80	0.24
91	600150	中国船舶	590,203	13,556,962.91	0.24
92	600010	包钢股份	2,751,588	13,427,749.44	0.24
93	600660	福耀玻璃	1,715,809	13,417,626.38	0.24
94	000060	中金岭南	1,546,555	13,331,304.10	0.24
95	000623	吉林敖东	766,017	13,282,734.78	0.24
96	600123	兰花科创	734,126	13,258,315.56	0.24
97	600009	上海机场	1,031,746	13,144,444.04	0.24
98	601958	金钼股份	1,036,614	13,133,899.38	0.24
99	002241	歌尔声学	355,746	12,981,171.54	0.23
100	601618	中国中冶	5,215,616	12,934,727.68	0.23
101	600315	上海家化	329,137	12,839,634.37	0.23
102	600549	厦门钨业	292,080	12,825,232.80	0.23
103	601666	平煤股份	1,264,001	12,791,690.12	0.23
104	600875	东方电气	712,612	12,770,007.04	0.23
105	600583	海油工程	2,082,381	12,681,700.29	0.23

106	000425	徐工机械	883,294	12,666,435.96	0.23
107	000012	南玻A	1,405,462	12,649,158.00	0.23
108	600196	复星医药	1,223,377	12,613,016.87	0.23
109	002081	金螳螂	326,200	12,395,600.00	0.22
110	002142	宁波银行	1,235,331	12,328,603.38	0.22
111	000039	中集集团	923,413	12,281,392.90	0.22
112	601117	中国化学	2,113,205	12,193,192.85	0.22
113	600085	同仁堂	697,149	12,165,250.05	0.22
114	600177	雅戈尔	1,430,428	12,144,333.72	0.22
115	600535	天士力	276,511	12,089,060.92	0.22
116	601991	大唐发电	2,139,894	12,047,603.22	0.22
117	600188	兖州煤业	633,994	12,033,206.12	0.22
118	002422	科伦药业	257,047	11,993,813.02	0.22
119	601998	中信银行	2,947,555	11,790,220.00	0.21
120	600143	金发科技	1,974,238	11,786,200.86	0.21
121	000009	中国宝安	1,167,715	11,677,150.00	0.21
122	002415	海康威视	428,312	11,650,086.40	0.21
123	600005	武钢股份	4,322,983	11,628,824.27	0.21
124	000581	威孚高科	423,736	11,610,366.40	0.21
125	000728	国元证券	1,051,390	11,470,664.90	0.21
126	601919	中国远洋	2,452,332	11,378,820.48	0.21
127	600415	小商品城	1,456,778	11,362,868.40	0.21
128	000937	冀中能源	743,081	11,346,846.87	0.20
129	600066	宇通客车	504,973	11,341,693.58	0.20
130	600369	西南证券	994,572	11,248,609.32	0.20
131	600271	航天信息	593,372	11,220,664.52	0.20
132	600881	亚泰集团	2,028,745	11,158,097.50	0.20
133	002155	辰州矿业	574,269	11,117,847.84	0.20
134	601111	中国国航	1,783,560	10,968,894.00	0.20
135	600166	福田汽车	1,504,428	10,756,660.20	0.19
136	600376	首开股份	800,152	10,594,012.48	0.19
137	002202	金风科技	1,645,145	10,545,379.45	0.19
138	600694	大商股份	314,479	10,519,322.55	0.19
139	600809	山西汾酒	278,098	10,481,513.62	0.19
140	000562	宏源证券	633,144	10,472,201.76	0.19
141	601808	中海油服	633,971	10,466,861.21	0.19
142	600115	东方航空	2,500,189	10,450,790.02	0.19
143	000768	西飞国际	1,326,642	10,414,139.70	0.19
144	600029	南方航空	2,255,687	10,398,717.07	0.19

145	600153	建发股份	1,437,868	10,295,134.88	0.19
146	600058	五矿发展	459,110	10,251,926.30	0.18
147	600252	中恒集团	935,045	10,248,093.20	0.18
148	000401	冀东水泥	721,280	10,141,196.80	0.18
149	600741	华域汽车	1,106,409	9,924,488.73	0.18
150	600497	驰宏锌锗	701,453	9,869,443.71	0.18
151	000729	燕京啤酒	1,350,672	9,859,905.60	0.18
152	000933	神火股份	1,079,373	9,843,881.76	0.18
153	000625	长安汽车	2,013,260	9,824,708.80	0.18
154	000869	张裕A	145,644	9,796,015.44	0.18
155	601901	方正证券	1,918,900	9,748,012.00	0.18
156	600655	豫园商城	1,230,920	9,699,649.60	0.18
157	000960	锡业股份	485,279	9,559,996.30	0.17
158	600395	盘江股份	354,394	9,526,110.72	0.17
159	000800	一汽轿车	871,351	9,462,871.86	0.17
160	000422	湖北宜化	769,235	9,423,128.75	0.17
161	000758	中色股份	492,609	9,344,792.73	0.17
162	002353	杰瑞股份	192,642	9,343,137.00	0.17
163	000999	华润三九	419,301	9,161,726.85	0.17
164	600832	东方明珠	1,705,479	9,158,422.23	0.17
165	600827	友谊股份	808,812	9,147,663.72	0.17
166	600779	水井坊	374,744	9,095,036.88	0.16
167	002106	莱宝高科	449,911	9,029,713.77	0.16
168	000528	柳工	722,950	8,971,809.50	0.16
169	601333	广深铁路	3,026,464	8,897,804.16	0.16
170	600649	城投控股	1,230,426	8,883,675.72	0.16
171	601106	中国一重	2,799,709	8,847,080.44	0.16
172	600259	广晟有色	133,533	8,803,830.69	0.16
173	601607	上海医药	823,418	8,785,870.06	0.16
174	601717	郑煤机	749,740	8,696,984.00	0.16
175	000825	太钢不锈	2,439,274	8,610,637.22	0.16
176	600804	鹏博士	1,433,436	8,514,609.84	0.15
177	600703	三安光电	618,364	8,415,934.04	0.15
178	000876	新希望	558,055	8,359,663.90	0.15
179	600839	四川长虹	3,954,720	8,344,459.20	0.15
180	002385	大北农	429,114	8,324,811.60	0.15
181	600219	南山铝业	1,242,475	8,324,582.50	0.15
182	600125	铁龙物流	978,523	8,297,875.04	0.15
183	600208	新潮中宝	1,994,625	8,237,801.25	0.15

184	002001	新和成	388,619	8,211,519.47	0.15
185	600267	海正药业	460,016	8,041,079.68	0.15
186	600588	用友软件	524,116	7,998,010.16	0.14
187	600320	振华重工	1,891,424	7,981,809.28	0.14
188	601888	中国国旅	282,758	7,979,430.76	0.14
189	600811	东方集团	1,443,823	7,912,150.04	0.14
190	002038	双鹭药业	244,490	7,872,578.00	0.14
191	601001	大同煤业	716,654	7,847,361.30	0.14
192	000898	鞍钢股份	1,974,750	7,701,525.00	0.14
193	600372	中航电子	427,189	7,685,130.11	0.14
194	600893	航空动力	583,294	7,588,654.94	0.14
195	002310	东方园林	129,180	7,584,157.80	0.14
196	002007	华兰生物	308,438	7,581,406.04	0.14
197	002092	中泰化学	988,748	7,563,922.20	0.14
198	601633	长城汽车	421,305	7,499,229.00	0.14
199	601179	中国西电	1,866,024	7,426,775.52	0.13
200	601101	昊华能源	428,114	7,329,311.68	0.13
201	600674	川投能源	1,055,905	7,306,862.60	0.13
202	600216	浙江医药	289,182	7,272,927.30	0.13
203	601918	国投新集	594,522	7,259,113.62	0.13
204	600266	北京城建	476,086	7,231,746.34	0.13
205	600108	亚盛集团	1,459,139	7,193,555.27	0.13
206	600331	宏达股份	884,146	7,108,533.84	0.13
207	600895	张江高科	829,132	7,105,661.24	0.13
208	000718	苏宁环球	874,773	7,085,661.30	0.13
209	600062	华润双鹤	367,465	7,011,232.20	0.13
210	601018	宁波港	2,740,176	6,932,645.28	0.13
211	600997	开滦股份	660,994	6,920,607.18	0.12
212	601928	凤凰传媒	800,767	6,886,596.20	0.12
213	000061	农产品	1,184,424	6,869,659.20	0.12
214	000778	新兴铸管	1,026,402	6,866,629.38	0.12
215	600718	东软集团	788,600	6,789,846.00	0.12
216	600859	王府井	247,798	6,779,753.28	0.12
217	000969	安泰科技	554,010	6,775,542.30	0.12
218	000839	中信国安	1,007,264	6,768,814.08	0.12
219	600664	哈药股份	1,026,574	6,765,122.66	0.12
220	600132	重庆啤酒	310,849	6,711,229.91	0.12
221	600863	内蒙华电	828,811	6,547,606.90	0.12
222	002146	荣盛发展	598,361	6,522,134.90	0.12

223	601866	中海集运	2,547,701	6,445,683.53	0.12
224	600550	天威保变	734,745	6,414,323.85	0.12
225	000046	泛海建设	1,433,207	6,406,435.29	0.12
226	600352	浙江龙盛	1,113,024	6,377,627.52	0.12
227	002069	獐子岛	304,593	6,350,764.05	0.11
228	600498	烽火通信	237,186	6,287,800.86	0.11
229	600118	中国卫星	490,603	6,176,691.77	0.11
230	600221	海南航空	1,265,703	6,176,630.64	0.11
231	600160	巨化股份	606,661	6,127,276.10	0.11
232	601158	重庆水务	1,028,074	6,055,355.86	0.11
233	000703	恒逸石化	362,857	6,034,311.91	0.11
234	601558	华锐风电	860,734	6,033,745.34	0.11
235	600316	洪都航空	460,559	6,001,083.77	0.11
236	600516	方大炭素	684,416	5,844,912.64	0.11
237	000807	云铝股份	988,421	5,821,799.69	0.11
238	601118	海南橡胶	841,507	5,781,153.09	0.10
239	600432	吉恩镍业	434,010	5,763,652.80	0.10
240	000680	山推股份	975,272	5,705,341.20	0.10
241	601336	新华保险	166,300	5,694,112.00	0.10
242	002299	圣农发展	394,295	5,693,619.80	0.10
243	600598	北大荒	761,358	5,672,117.10	0.10
244	600508	上海能源	309,270	5,607,065.10	0.10
245	600812	华北制药	880,910	5,602,587.60	0.10
246	002128	露天煤业	425,855	5,570,183.40	0.10
247	601555	东吴证券	629,211	5,562,225.24	0.10
248	601098	中南传媒	576,668	5,524,479.44	0.10
249	600169	太原重工	1,556,667	5,463,901.17	0.10
250	600770	综艺股份	473,074	5,430,889.52	0.10
251	600970	中材国际	468,006	5,400,789.24	0.10
252	600170	上海建工	742,858	5,363,434.76	0.10
253	002073	软控股份	635,670	5,326,914.60	0.10
254	600528	中铁二局	781,205	5,280,945.80	0.10
255	600500	中化国际	778,090	5,259,888.40	0.09
256	600418	江淮汽车	965,617	5,223,987.97	0.09
257	600022	山东钢铁	2,024,634	5,203,309.38	0.09
258	000059	辽通化工	649,965	5,141,223.15	0.09
259	600037	歌华有线	681,329	5,130,407.37	0.09
260	601566	九牧王	181,813	5,063,492.05	0.09
261	601377	兴业证券	470,803	4,934,015.44	0.09

262	601369	陕鼓动力	526,223	4,872,824.98	0.09
263	000686	东北证券	273,886	4,694,406.04	0.08
264	002344	海宁皮城	179,908	4,692,000.64	0.08
265	000961	中南建设	375,168	4,674,593.28	0.08
266	600109	国金证券	321,059	4,620,039.01	0.08
267	000780	平庄能源	434,003	4,548,351.44	0.08
268	600595	中孚实业	810,502	4,522,601.16	0.08
269	600971	恒源煤电	321,119	4,473,187.67	0.08
270	601933	永辉超市	164,464	4,456,974.40	0.08
271	600546	山煤国际	212,222	4,439,684.24	0.08
272	601992	金隅股份	666,875	4,434,718.75	0.08
273	600456	宝钛股份	230,342	4,323,519.34	0.08
274	000559	万向钱潮	852,636	4,288,759.08	0.08
275	002500	山西证券	519,805	4,257,202.95	0.08
276	002431	棕榈园林	164,369	4,239,076.51	0.08
277	000968	煤气化	275,003	4,193,795.75	0.08
278	002122	天马股份	636,150	4,109,529.00	0.07
279	600096	云天化	297,069	3,939,134.94	0.07
280	600183	生益科技	760,998	3,919,139.70	0.07
281	601718	际华集团	1,238,392	3,913,318.72	0.07
282	600873	梅花集团	579,348	3,910,599.00	0.07
283	600783	鲁信创投	238,898	3,812,812.08	0.07
284	000021	长城开发	706,408	3,800,475.04	0.07
285	002493	荣盛石化	238,148	3,650,808.84	0.07
286	002399	海普瑞	171,194	3,629,312.80	0.07
287	601258	庞大集团	561,136	3,422,929.60	0.06
288	600151	航天机电	518,258	3,353,129.26	0.06
289	601099	太平洋	483,000	3,332,700.00	0.06
290	002603	以岭药业	118,129	3,254,453.95	0.06
291	600307	酒钢宏兴	874,905	3,035,920.35	0.05
292	002405	四维图新	246,829	2,947,138.26	0.05
293	002378	章源钨业	91,659	2,901,923.94	0.05
294	601233	桐昆股份	309,269	2,703,011.06	0.05
295	601268	二重重装	362,011	2,219,127.43	0.04
296	601216	内蒙君正	273,712	1,907,772.64	0.03
297	002570	贝因美	89,159	1,796,553.85	0.03
298	002594	比亚迪	84,300	1,674,198.00	0.03

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

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	22,380,786.43	0.41
2	600011	华能国际	21,747,848.18	0.40
3	000629	攀钢钒钛	19,836,147.00	0.36
4	601669	中国水电	17,935,049.90	0.33
5	000725	京东方A	16,765,416.46	0.31
6	601939	建设银行	14,941,854.38	0.27
7	000581	威孚高科	14,493,160.93	0.27
8	002241	歌尔声学	13,027,964.27	0.24
9	600315	上海家化	12,860,760.54	0.24
10	002081	金螳螂	12,396,929.91	0.23
11	601991	大唐发电	12,129,359.43	0.22
12	600252	中恒集团	10,415,324.73	0.19
13	601901	方正证券	9,563,504.06	0.18
14	600827	友谊股份	9,269,363.23	0.17
15	002353	杰瑞股份	9,113,982.91	0.17
16	002038	双鹭药业	7,853,897.40	0.14
17	600015	华夏银行	7,781,159.19	0.14
18	600160	巨化股份	7,760,517.71	0.14
19	600770	综艺股份	7,267,624.85	0.13
20	601633	长城汽车	7,224,928.19	0.13

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。

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

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	600016	民生银行	16,472,428.00	0.30
2	601318	中国平安	15,223,321.06	0.28
3	601328	交通银行	12,681,196.58	0.23
4	600036	招商银行	12,404,272.26	0.23
5	601166	兴业银行	11,801,489.51	0.22

6	600000	浦发银行	11,727,992.84	0.22
7	601727	上海电气	10,710,014.96	0.20
8	600519	贵州茅台	9,977,620.40	0.18
9	601088	中国神华	9,972,105.18	0.18
10	600837	海通证券	9,916,320.29	0.18
11	600030	中信证券	9,289,767.79	0.17
12	000002	万科A	9,213,611.39	0.17
13	000858	五粮液	7,799,281.32	0.14
14	601601	中国太保	7,501,706.64	0.14
15	600635	大众公用	7,146,269.85	0.13
16	601939	建设银行	7,122,454.74	0.13
17	600582	天地科技	6,906,706.03	0.13
18	601398	工商银行	6,800,059.66	0.12
19	601857	中国石油	6,537,449.80	0.12
20	600008	首创股份	6,279,093.66	0.12

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。

7.4.3 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	509,093,558.77
卖出股票收入（成交）总额	684,154,593.35

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

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。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	399,546.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,614,881.90
4	应收利息	67,783.66
5	应收申购款	1,430,664.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,512,877.19

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无流通受限情况。

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 基金份额持有人信息

8.1 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
370,250	19,716.47	895,063,868.10	12.26%	6,404,958,287.53	87.74%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 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	430,989.49	0.006%
-------------------	------------	--------

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至10万份（含）

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	366,716,165.60
减：本报告期基金总赎回份额	630,330,568.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,300,022,155.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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，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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	377,091,092.36	31.77%	313,731.84	31.28%	-
国信证券	1	315,647,060.03	26.59%	268,298.56	26.75%	-
中信建投	3	212,244,276.59	17.88%	185,289.66	18.47%	-
西部证券	1	100,246,558.97	8.44%	81,451.18	8.12%	-
兴业证券	2	91,201,502.49	7.68%	77,293.34	7.71%	-
光大证券	2	80,518,599.48	6.78%	68,440.87	6.82%	-
申银万国	1	10,137,251.44	0.85%	8,616.74	0.86%	-
银河证券	3	-	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	1	-	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%	-
上海证券	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%	-
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	2	-	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%	-

注：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。

本基金本报告期内租用交易单元变更情况。

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成沪深 300 指数证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-1-20
2	大成沪深 300 指数证券投资基金 2011 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-3-28
3	大成沪深 300 指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-3-28
4	大成沪深 300 指数证券投资基金 2012 年第 1 季度报	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-4-21
5	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-5-19
6	大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-5-19
7	关于赎回公司持有旗下部分开放式基金的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-6-8

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成沪深 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）。

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>。

大成基金管理有限公司

2012年8月25日