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

2013 第二季度 报告

2013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
报告送出日期:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	大成深证成长40ETF联接
交易代码	090012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月21日
报告期末基金份额总额	1,844,759,406.09份
投资目标	通过投资于深证成长40交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证成长40ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资深证成长40ETF,本基金并不参与深证成长40ETF的管理。 本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证成长40价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,紧密跟踪标的指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.2目标基金基本情况

基金名称	深证成长40交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159906
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年12月21日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年2月23日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
目标基金投资目标	紧密跟踪标的指数,追求与标的指数类似的投资回报
目标基金投资策略	本基金主要采取完全复制法,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进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
目标基金业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数,本基金标的指数为深证成长40价格指数。如果指数编制单位变更或停止深证成长40价格指数的编制及发布,或深证成长40价格指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致深证成长40价格指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,并履行适当程序后,变更本基金的标的指数。
目标基金风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-9,482,926.99
2.本期利润	-53,253,203.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0281
4.期末基金资产净值	1,329,618,592.13
5.期末基金份额净值	0.721

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人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。

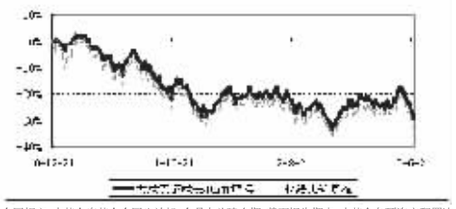
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-3.99%	1.38%	-4.27%	1.37%	0.28%	0.01%

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,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏秉毅先生	本基金基金经理	2012年2月9日	-	9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,现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理,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合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,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 公平交易专项说明

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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有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。2013年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在3笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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,但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%;投资组合间不存在债券同日反向交易。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;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表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年二季度,宏观经济复苏弱于市场预期,各项数据均不如人意。外贸水分被大幅挤压,出口增速回落至低位,PMI数据也表明内需依旧低迷。产业经济结构也并不均衡,部分行业产能过剩严重。在结构调整、存量货币表外空转等因素的制约下,政府也难以放松流动性,以至于在季度末出现罕有的"钱荒"。尽管新股发行尚未重启,但资金面仍然承受了极大的压力。

在多路利空合力作用下,二季度市场一路下行,并在季末加速下滑。A股市场基准沪深300指数下跌11.80%。板块分化较为严重,一定程度上反映了相关上市公司的景气预期。传统行业占比较高的大盘蓝筹表现不佳,而以新兴行业为主体的中小板、创业板则表现不俗,其中创业板尤其突出,本季度逆市上涨16.76%。在行业方面,信息、电子、医药等行业明显跑赢大市,而煤炭、有色、钢铁等产能过剩的行业则成为下跌的重灾区。

本基金标的指数深证成长40指数下跌4.53%,跌幅小于大盘。二季度,根据基金合同的约定,投资于目标ETF份额的资产不低于基金资产净值的90%,通过完全复制法等方式,使联接基金和目标ETF的走势基本一致。本季年化跟踪误差2.45%,日均偏离度0.10%,各项操作与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0.721元,本报告期基金份额净值增长率为-3.99%,同期业绩比较基准收益率为-4.27%,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

经历了上季度的反复,宏观经济已经见底复苏的论断有待重新论证。面临经济结构失衡、货币运转效率较低的局面,货币政策腾挪的空间不大。上季度末矛盾集中爆发后,尽管央行可能采取相对温和的处理方式,但流动性收紧的基调难以改变。

另一方面,财政政策施展的空间也有限。虽然短期内经济仍需投资拉动,但政府若继续按照老路刺激经济,不仅"国进民退"愈演愈烈,影响私人部门投资热情,而且效率较低,达不到淘汰落后产能的目的。在经济转型期,财政政策预计将较为保守。

综合来看,宏观经济增速下滑已不可避免,并将反映到上市公司的盈利水平上。虽然也会有少数板块逆周期发展,但总体来说,股市基本面将有所恶化。同时,股市资金面形势也较为严峻:金融系统局部去杠杆化将传导至股市;IPO重启的压力挥之不去;QE退出预期导致热钱流出,各方面影响叠加下,下季度资金面不容乐观。

基于以上的分析,我们对下季度A股市场持相对悲观的态度。在没有重大利好的情况下,牛市基础并不具备,不可能有反转性质的大行情。场内资金有限,少数中报业绩较好或具备题材的股票有可能受到追捧,走出相对独立的行情;与之相对应的,将是大多数基本面乏善可陈、无法吸引资金关注的股票。另外,部分估值水平较高的成长股,一旦成长速度低于市场预期,无法支撑其估值水平,将有较高的回调风险。

组合管理上,我们将严格遵守基金合同约定,保持目标ETF份额不低于基金资产净值的90%,使联接基金和目标ETF的走势基本一致,力争实现紧密跟踪标的指数的投资目标。若由于申购赎回等原因需要调整组合,我们将主要通过一级市场申购或赎回的方式,增持或减持目标ETF份额。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,823.00	0.00
	其中:股票	3,823.00	0.00
2	基金投资	1,247,429,500.00	93.77
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
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	银行存款和结算备付金合计	82,664,955.17	6.21
7	其他资产	264,923.97	0.02
8	合计	1,330,363,202.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	3,823.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	3,823.00	0.00

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	100	3,823.00	0.00

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	大成深证成长40ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	大成基金管理有限公司	1,247,429,500.00	93.82

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	131,453.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,159.83
5	应收申购款	118,311.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	264,923.97

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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不存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,947,956,795.56
本报告期基金总申购份额	4,966,999.72
减:本报告期基金总赎回份额	108,164,389.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,844,759,406.09

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件;

2、《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合同》;

3、《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。

7.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

7.3 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。

大成基金管理有限公司
2013年7月18日

大成标普500等权重指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500 等权重指数QDII
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
报告期末基金份额总额	75,904,589.19份
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(金收益指数)
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。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

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		-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	1,541,618.08
2.本期利润	792,274.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0095
4.期末基金资产净值	85,532,242.71
5.期末基金份额净值	1.127

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。

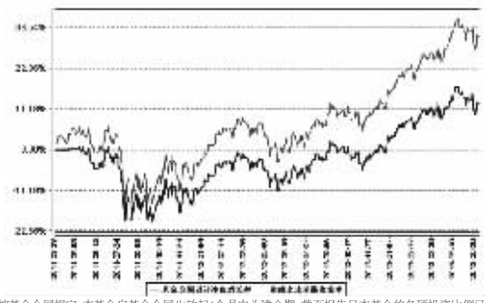
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	1.08%	0.91%	3.24%	0.96%	-2.16%	-0.05%

注: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。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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起6个月内为建仓期,截至报告日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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	10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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.4.1 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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有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。2013年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在3笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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,但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%;投资组合间不存在债券同日反向交易。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;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表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年2季度,国际宏观经济形势相对平稳。欧洲的金融体系保持了相对的稳定,但是其宏观经济增长状况依然不乐观,仍然保持轻微的衰退状态。日本的量化宽松政策增加了全球资本市场的资金供应。

2013年2季度,美国的宏观经济继续保持稳健的增长,虽然美国的1季度GDP增速略低于初值,但仍然保持在仅仅略低于长期增长趋势的水平上。2季度以来,美国众多的宏观经济数据都有较佳的表现,尤其是房地产市场增长更为强劲,因此综合来看,美国2季度的宏观经济或将仍有较好的表现。

但是,由于美国经济增长较佳,美联储已经在研究退出量化宽松政策的条件与时间,因此市场参与者已经开始考虑美联储退出量化宽松政策后的影响,这造成了全球金融市场的短期波动。在本报告期内,本基金的目标指数上涨3.24%,美元兑人民币中间价下跌1.52%,经汇率调整后的目标指数上涨1.67%。在本报告期内,本基金净值上涨0.99%,低于经汇率调整后的目标指数0.69%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为0.96%,日均偏差绝对值为0.05%,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1.127元,本报告期基金份额净值增长率为1.08%同期业绩比较基准收益率为3.24%,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3季度,欧元区金融体系有望保持稳定,同时,欧洲的宏观经济虽然难言走上复苏之路,但其衰退的幅度有望显著缩小。

展望2013年3季度,美国宏观经济有望持续保持稳定增长,尤其是个人收入增长所带来的消费增长和房地产市场的显著复苏会继续推动宏观经济的增长。

根据美联储主席伯南克的讲话,美联储可能在一定的经济条件下于今年晚些时候开始缩减其资产购买规模。但是,美联储退出量化宽松政策的条件是不会给经济带来下行风险,因此对金融状况和经济增长的影响也应较为有限。

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,持续实施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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	79,634,073.24	81.39
	其中:普通股	79,634,073.24	81.39
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	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	15,407,018.97	15.75
8	其他资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	79,634,073.24	93.10
合计	79,634,073.24	93.10

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末按投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
消费者非必需品	13,292,364.60	15.54
金融	13,087,157.15	15.30
信息技术	11,197,350.18	13.09
工业	9,666,065.44	11.30
医疗保健	8,597,748.35	10.05
能源	6,788,299.92	7.94
消费者常用品	6,291,914.19	7.36
公用事业	4,982,683.11	5.83
基础材料	4,642,408.21	5.43
电信服务	1,088,082.09	1.27
合计	79,634,073.24	93.10

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.4 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

5.4.1 报告期末指数投资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

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	美国	1,786	185,611.36	0.22
2	Micron Technology Inc	美光技术公司	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	2,054	181,862.74	0.21
3	Newfield Exploration Co	新加石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	1,198	176,835.75	0.21
4	FLIR Systems Inc	FLIR系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,056	175,971.35	0.21
5	People's United Financial Inc	People's United Financial公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,905	175,379.31	0.21
6	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	美国	3,097	175,280.57	0.20
7	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	美国	252	175,135.00	0.20
8	GameStop Corp A	GameStop公司	GME UN	纽约交易所	美国	672	174,512.19	0.20
9	Schwab Charles Corp	嘉信理财公司	SCHW UN	纽约交易所	美国	1,330	174,461.16	0.20
10	Perrigo Co	Perrigo公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	232	173,448.47	0.20

5.4.2 报告期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告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融衍生品。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,120,393.06
3	应收股利	100,257.99
4	应收利息	984.58
5	应收申购款	1,451,740.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	130,042.24
8	其他	-
9	合计	2,803,418.57

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告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。

5.10.5.2 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	85,578,687.38
本报告期基金总申购份额	19,410,154.03
减:本报告期基金总赎回份额	29,084,252.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,904,589.19

§7 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成标普500等权重指数证券投资基金的文件;

2、《大成标普500等权重指数证券投资基金基金合同》;

3、《大成标普500等权重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。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 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。

大成基金管理有限公司
2013年7月18日

大成内需增长股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。