大成中证红利指数证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成中证红利指数
交易代码	090010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月2日
报告期末基金份额总额	70,439,753.67份
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,紧密跟踪标的指数,追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及其他特殊情况 如成份股流动性不足 时本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整,以实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证红利指数×95%+银行活期存款利率 税后 ×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	1,338,594.59
2.本期利润	-488,031.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0069
4.期末基金资产净值	91,195,192.23
5.期末基金份额净值	1.295

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。

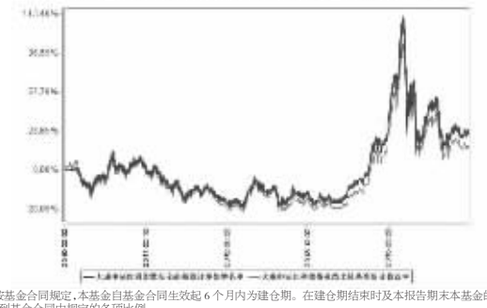
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.54%	0.98%	-2.23%	0.97%	1.69%	0.01%

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: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。在建仓期结束时及本报告期末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。

§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		
夏高先生	本基金基金经理	2014年12月6日	-	5年	工学博士。2011年1月至2012年5月就职于博时基金管理有限公司,任投票投资部投资分析员。2012年7月加入大成基金管理有限公司,历任数量投资部高级数量分析师及基金经理助理。2014年12月6日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年2月3日起担任大成中证360互联网+大数据100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 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》、《大成中证红利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,大成中证红利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 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,内容包括投权、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。2016年2季度公司旗下主动投资组合同股票交易不存在同日反向交易;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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年二季度,宏观经济仍处于探底过程,尚未看到明显的复苏迹象。PMI和民间投资都比较弱,需要国家政策的进一步支持。因宏观经济条件的约束,央行没有进行"降息降准"的操作。人民币汇率进一步下调,债券市场出现了多起违约事件。由于受到多种因素的制约,股票市场在二季度处于底部窄幅震荡的阶段。上证指数下跌2.47%,沪深300指数下跌1.99%,中证红利指数下跌2.37%。

在本报告期内,本基金严格按照中证红利指数的成分及其权重构建投资组合,较好地跟踪了基准指数,基金年化跟踪误差为1.01 %,日均偏离度为0.0283%,各项指标均符合基金合同的要求。

4.5 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1.295元,本报告期基金份额净值增长率为 -0.54%,同期业绩比较基准收益率为 -2.23%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	84,918,798.42	92.77
	其中:股票	84,918,798.42	92.77
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	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	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
7	银行存款和结算备付金合计	6,588,292.43	7.20
8	其他资产	25,465.54	0.03
9	合计	91,532,556.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,774,173.94	4.14
C	制造业	35,022,496.74	38.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,880,201.58	13.03
E	建筑业	1,733,917.82	1.90
F	批发和零售业	3,401,226.80	3.73
G	交通运输、仓储和邮政业	7,996,940.62	8.77
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	16,252,793.12	17.82
K	房地产业	4,857,047.80	5.33
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	84,918,798.42	93.12

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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

5.3.1 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	601398	工商银行	428,427	1,902,215.88	2.09
2	601288	农业银行	592,029	1,894,492.80	2.08
3	600104	上汽集团	90,035	1,826,810.15	2.00
4	000568	泸州老窖	56,876	1,689,217.20	1.85
5	600000	浦发银行	107,281	1,670,365.17	1.83
6	600036	招商银行	91,675	1,604,312.50	1.76
7	600507	方大特钢	333,912	1,602,777.60	1.76
8	000651	格力电器	79,430	1,526,644.60	1.67
9	601988	中国银行	465,034	1,492,759.14	1.64
10	601328	交通银行	263,135	1,481,450.05	1.62

5.3.2 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,304.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,157.36
5	应收申购款	22,003.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,465.54

5.11.4 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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	1,526,644.60	1.67	临时停牌

5.11.5.2 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

本基金报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	71,960,834.64
报告期期间基金总申购份额	2,269,181.67
减:报告期期间基金总赎回份额	3,790,262.64
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	70,439,753.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立大成中证红利指数证券投资基金的文件;

2.《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》;

3.《大成中证红利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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2016年7月20日

大成标普500等权重指数证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:2016年7月20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2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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	43,715,505.59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,基金管理人将指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。
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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	422,720.93
2.本期利润	2,431,588.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0643
4.期末基金资产净值	64,561,554.74
5.期末基金份额净值	1.477

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。

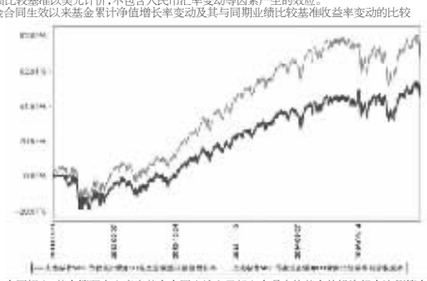
3.2 基金净值表现

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	4.16%	0.92%	2.66%	1.05%	1.50%	-0.13%

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.本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六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,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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	-	13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日起担任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起担任大成纳斯达克100指数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,内容包括投权、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。2016年2季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易;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,但不存在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%的交易情形;投资组合间债券交易不存在同日反向交易;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

2016年2季度,国际经济局势有较大变动。6月底,英国举行公投,其结果为"脱离欧盟"。公投结果公布后,对全球金融市场造成了较大的动荡,各大股票市场都出现了明显的短期下跌,但美国股票市场的跌幅随后又得以回复。

对于全球经济而言,由于英国退欧的过程较为漫长和复杂,因此其确切的影响较难估算。但就中长期而言,如果由退欧这一政治事件对英国和欧盟的经济政策所产生的不确定性不断发酵,则英国与欧盟的投资将持续受到抑制,其未来经济的复苏也将更加步履维艰。

2季度,美国宏观经济表现较为平淡,但仍保持在增长的轨道上。美国一季度GDP环比年化增长率为1.1%,低于此前的三个季度,但其是近三年来一季度GDP增速中最高值。

美国一季度GDP保持增长的原因是,企业投资、居民消费、营建支出和商品贸易都保持增长。同时,因就业率维持高位,居民收入大幅上升,而通胀维持低位,消费支出低于收入增速,美国储蓄率上升至近年来最高水平。即使在英国退出欧盟过程中,美国经济受到的影响也相对较小。

由于英国"退欧"事件,美联储对于加息表现更为审慎,当前预计2016年仅还有一次加息机会。虽然加息预期降低,但由于欧洲不稳定性增强,因此美元预计仍会保持强势。

2季度,美元相对于人民币继续保持升值的趋势,这有利于本基金净值的表现。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨2.66%,美元兑人民币中间价上涨2.63%,经汇率调整后的目标指数上涨5.37%。在本报告期内,本基金净值上涨4.16%,低于经汇率调整后的目标指数1.20%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.81%,日均偏差绝对值为0.0195%,均显著低于本基金合同中的目标值。

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,以期更好地跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.477元,本报告期基金份额净值增长率为4.16%,同期业绩比较基准收益率为2.66%,高于业绩比较基准的表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	60,659,111.51	84.88
	其中:普通股	60,659,111.51	84.88
	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	7,686,616.61	10.76
8	其他资产	3,116,500.05	4.36
9	合计	71,462,228.17	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	60,659,111.51	93.96
合计	60,659,111.51	93.96

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 报告期末指数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(%)
金融	11,078,090.49	17.16
消费者非必需品	9,988,158.09	15.47
工业	8,116,097.98	12.57
信息技术	8,090,021.44	12.53
医疗保健	6,763,055.49	10.48
能源	4,698,926.10	7.28
消费者常用品	4,524,572.71	7.01
公用事业	3,682,993.41	5.70
基础材料	3,086,623.79	4.78
电信服务	630,572.01	0.98
合计	60,659,111.51	93.96

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股票及存托凭证投资明细

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股票及存托凭证投资明细

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	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,066	145,194.37	0.22
2	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	191	143,741.80	0.22
3	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	1,519	138,601.63	0.21
4	Gap Inc	Gap公司	GPS UN	纽约交易所	美国	975	137,196.21	0.21
5	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	美国	1,374	136,760.14	0.21
6	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	美国	1,647	136,301.40	0.21
7	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	462	135,350.48	0.21
8	Transocean Ltd	Transocean公司	RIG UN	纽约交易所	美国	1,716	135,297.97	0.21
9	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	美国	304	134,640.95	0.21
10	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	美国	552	134,081.27	0.21

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股票及存托凭证投资明细

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序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序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序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	-
3	应收股利	61,200.27
4	应收利息	489.55
5	应收申购款	2,939,713.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	115,096.26
8	其他	-
9	合计	3,116,500.05

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

报告期期初基金份额总额	36,622,938.51
报告期期间基金总申购份额	13,767,666.56
减:报告期期间基金总赎回份额	6,675,099.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	43,715,505.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2016年6月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第十七次会议审议通过,钟鸣远先生不再担任公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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
2016年7月20日

大成中证互联网金融指数分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成互联网金融指数分级		
场内简称	互联金融		
交易代码	502036		
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)		
基金合同生效日	2015年6月29日		
报告期末基金份额总额	101,833,176.77份		
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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,力求降低跟踪误差。 本基金力争互联网金融分级净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	95%×中证互联网金融指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,紧密跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。从本基金所分离的两类基金份额来看,互联网金融A份额具有低预期风险、预期收益较高的特征;互联网金