

大成标普500等权重指数证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

报告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：
 基金管理人负责人：王鹏刚 主管会计工作负责人：刘彩卿 会计机构负责人：范瑛

6.4.1 本报告期采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明。
 6.4 报表附注

6.4.2 税项
 根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]11号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实施操作,主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
 （2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免营业税和企业所得税。
 （3）对基金取得的国债利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。
 （4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
 6.4.3 关联方关系
 6.4.3.1 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。
 6.4.3.2 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(“大成基金”) 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
 中国银行股份有限公司(“中国银行”) 基金托管人、基金代销机构
 中国证券监督管理委员会(“中国证监会”) 境外资产托管人
 中泰信托有限责任公司 基金管理人股东
 光大证券股份有限公司(“光大证券”) 基金管理人股东、基金代销机构
 中国银河证券股份有限公司 基金管理人股东
 广东证券股份有限公司(“广东证券”) 基金管理人股东

注：1、中国证监会于2005年11月6日作出《广东证券取消业务许可并责令关闭的行政决定》。
 2、上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
 本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。
 6.4.4.1 关联方报酬
 6.4.4.1.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	459,566.38	662,407.76
其中：支付销售机构客户的资产管理费	176,032.47	278,974.84

注：支付基金管理人大成基金的管人报酬按前一基金资产净值1.0%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：
 日管理人报酬=前一基金资产净值 X 1.0% ÷ 当年天数。

6.4.4.1.2 基金托管费
 注：基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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 0.25% ÷ 当年天数。
 6.4.4.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
 本报告期及上年度可比期间内本基金未发生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 各关联方投资本基金的情况
 6.4.4.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
 本报告期及上年度可比期间内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。
 6.4.4.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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
当期发生的基金应支付的托管费	114,891.57	165,601.93

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 0.25% ÷ 当年天数。
 6.4.4.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
 本报告期及上年度可比期间内本基金未发生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 各关联方投资本基金的情况
 6.4.4.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
 本报告期及上年度可比期间内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。
 6.4.4.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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
中国工商银行	10,824,593.66	-
中国建设	4,582,423.31	12,691.80
中国光大	-	6,553,575.62
中国交通	-	1,666,613.43
中国民生	-	13,451.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。
 6.4.4.5 本基金在承销期间参与与关联方承销的情况
 本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期间内参与关联方承销证券。
 6.4.4.6 其他关联交易事项的说明
 本基金本报告期无应作说明的其他关联交易事项。
 6.4.5 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券
 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
 于本报告期末,本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。
 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
 于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

序号	项目	金额	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
	优先权证	-	0.00
	权证	-	0.00
	房地产信托投资	-	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
	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	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布
 金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	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

1	Cablevision Systems Co	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	1,786	185
2	Micron Technology Inc	美光技术公司	MU UQ	纳斯达克交易所	US	2,054	181
3	Newfield Education Co	新田野教育集团	NFX UN	纽约交易所	US	1,198	176
4	FLIR Systems Inc	FLIR系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	1,056	175
5	Peoples United Financial Inc	People's United Financial Inc	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	1,005	175
6	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	3,097	175

7.3 期末按行业分类的权益投资组合
 7.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合
 金额单位:人民币元

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	占基金资产净值比例(%)
1	Cadabrier Systems Co A	有电系统系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	1,786	185,611.36	0.22
2	Microm Technology Inc	美光技术公司	MU UQ	纳斯达克交易所	US	2,054	181,862.74	0.21
3	Newfield Exploration Co	新弗尔德勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	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	US	1,056	175,971.35	0.21
5	Peoples United Financial Inc	People's United Financial公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	1,905	175,379.31	0.21
6	Hudson City Bancorp	哈德森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	3,097	175,280.57	0.20
7	Twcnetwer Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	252	175,135.00	0.20
8	GameStop Corp A	GameStop公司	GME UN	纽约交易所	US	672	174,512.19	0.20
9	Schwab Charles Corp	嘉信理财公司	SCHE UN	纽约交易所	US	1,330	174,461.16	0.20
10	Perigee Co	Perigee公司	PRGO UN	纽约交易所	US	232	173,448.47	0.20

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dfund.com.cn>)的半年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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
 送出日期:2013年8月29日

§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。在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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月28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,也不保证基金份额持有人资产不受损失,投资者投资于本基金,须自行承担投资风险。

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

本报告中所载资料未经审计。

本报告自2013年01月01日起至06月30日止。

本报告由中财证券材料部经济出行。

本报告自2013年01月01日起至06月30日止。

2.2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500 等权重指数QDII
基金主代码	096001
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
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
报告期末基金份额总额	75,504,589.19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	本基金将跟踪和复制的成份股及其权重作为资产配置核心策略,并参照标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,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,基金管理人将根据使用其他替代方法进行替代。本基金还可将一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数的公募基金,本基金为股票基金,以优化投资组合的建立,达到资产多元化配置和收益跟踪标的指数的投资目的。
业绩比较基准	标普500等权重指数(含收益再投资)
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 杜鹏 联系电话 0755-83183388 电子邮箱 dhpeng@dfund.com.cn	姓名 谢雨薇 电话 95566 tgxy@bank-of-china.com
客户服务电话	4008885558	95566
传 真	0755-83199588	010-66594942

2.5 信息披露方式	
基金基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dfund.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1号中国银行股份有限公司托管及信息披露部
§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 期间数据指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	2,958,835.98
本期利润	10,322,851.55
加权平均基金份额本期利润	0.1231
本基金份额净值增长率	12.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0214
期末基金资产净值	85,532,242.71
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下列数字。

本期已实现收益	2,958,835.98
未本期利	10,322,851.55
加权平均基金份额本期利润	0.1231
本期基金份额净值增长率	12.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0214
期末基金资产净值	85,532,242.71
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认购或交易基金的各项费用，计入费用后其收益水平要低于所列数字。

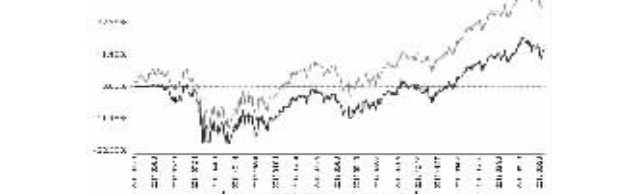
3.2 净值表现

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	-1.23%	1.03%	-1.08%	1.13%	-0.15%	-0.10%
过去三个月	1.08%	0.91%	3.24%	0.97%	-2.16%	-0.06%
过去六个月	12.14%	0.85%	16.17%	0.87%	-4.03%	-0.02%
过去一年	19.13%	0.80%	26.46%	0.84%	-7.33%	-0.04%
自基金合同生效起至今	12.70%	1.19%	31.01%	1.27%	-18.31%	-0.08%

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：1、按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。
 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。

4.1 基金管理人及基金经理情况
 4.1.1 基金管理人的基金经理经验
 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,是中国证监会批准的较早十家基金管理公司之一。注册资本2.6亿元人民币,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2013年6月30日,本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金:景顺证券投资基金和景福证券投资基金,3只ETF及2只ETF联接基金:深证成长40ETF、大成深证成长40ETF联接基金、中证500沪ETF及大成中证500沪ETF联接基金、大成中证100ETF、1只创新型基金:大成聚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28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、大成财富增值2010年周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成成长双动力股票型证券投资基金、大成保本混合证券投资基金、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、大成聚恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金、大成现金宝场内3个月中债货币市场基金、大成景安阳福债券型证券投资基金、大成现金内债债券型证券投资基金。
 4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理简介