# 大成保本混合型证券投资基金

## 2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年1月22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2014年1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10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成保本混合 |
| 交易代码 | 090013 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年4月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 542,644,033.08份 |
| 投资目标 | 依照保证合同,本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资采用VPPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance),VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整,修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在保证风险资产可能的损失额不超过扣除相关费用后的保本资产的潜在收益与基金前期收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、可分离债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、权证等高风险资产。 |
| 业绩比较基准 | 3年期银行定期存款利率(税后),按按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。 |
| 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 |
| 基金保证人 | 中国投资担保有限公司 |

### §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(2013年10月1日-2013年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -373,497.54 |
| 2.本期利润 | -2,605,363.44 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0046 |
| 4.期末基金资产净值 | 563,798,692.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.039 |

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。

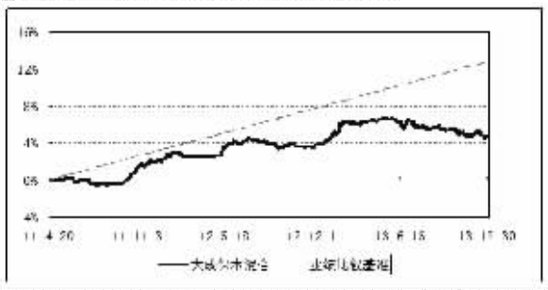
2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -0.48% | 0.10% | 1.07% | 0.01% | -1.55% | 0.09% |

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 | | |
| 陈尚前先生 | 本基金基金经理、固定收益部总监 | 2011年4月20日 | - | 14年 | 南开大学经济学博士,曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资业主任和招商证券股份有限公司研究发展中心策略部经理,2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理,2008年8月6日开始担任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15日至2013年10月15日任大成景丰分段债券型证券投资基金基金经理,2011年4月20日起兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2013年10月16日起兼任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理,现同时担任公司固定收益部总监、固定收益投资决策委员会主席、负责公司固定收益证券投资业务,并兼任大成国际资产管理有限公司董事。具有基金从业资格。国籍:中国 |
| 朱文辉先生 | 本基金基金经理 | 2011年6月4日 | 2013年11月8日 | 13年 | 工商管理硕士。2000年9月至2002年1月就职于平安保险集团总公司投资管理中心任债券研究员,2002年1月至2003年1月就职于东方保险投资有限公司投资管理中心任债券投资经理,2003年1月至2005年12月就职于生命人寿保险股份有限公司资产管理部任助理总经理,2006年1月至2010年12月就职于汇丰晋信基金管理有限公司基金投资部任固定收益投资副总监,2008年12月3日至2010年12月4日兼任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理,2011年加入大成基金管理有限公司,2011年6月4日至2013年11月8日任大成保本混合型证券投资基金基金经理,2011年11月30日至2013年11月8日任大成可转债债券基金基金经理,2012年6月15日至2013年11月8日任大成景丰债券基金基金经理。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》、《大成保本混合型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,大成保本混合型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4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,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%的仅有1笔,原因为投资策略需要;公司旗下主动投资组合间存在1笔债券同日反向交易,原因为投资策略需要;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

2013年四季度总体上仍然延续了前三季度结构性行情的特征,但成长股四季度出现大幅波动。创业板指数在10月份大幅下跌9.68%,四季度下跌4.64%。其它指数上均表现为下跌,其中沪深300指数下跌3.28%,中小板下跌4.86%。

长期来看,本基金仍然看好未来的成长股行情,经济结构转型下的新经济仍然是未来投资的主力方向。因此本基金虽然在四季度做出了一些成长股的减持,但总体上成长股的仓位仍然较大。表现在净值上,四季度净值回撤较大,基金四季度下跌6.94%,跑输沪深300和中小板指数。

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1.141元,本报告期基金份额净值增长率为-6.94%,业绩比较基准收益率为-2.93%,低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

未来中国经济继续走在十字路口,旧经济发展模式不可持续已得到了中央的认可,经济结构转型已是大势所趋。GDP增速在小区间的窄幅波动并不会对证券市场的走势产生很大的影响,市场的走势更多的是取决于中国经济长期增长模式的信心。

2013年是成长和周期的分化,代表新兴经济的成长股基本上都录得较大涨幅。往后看2014年,2014年可能是成长股内部的分化,真正用业绩证明自身的成长股将会继续受到市场的追捧,甚至不排除在2014年的一季度出现阶段性极度泡沫化的状态。

未来,本基金将以更严格的业绩标准继续自下而上选择成长股,以期取得更好收益。

### §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 | 33,471,967.53 | 5.54 |
| | 其中:股票 | 33,471,967.53 | 5.54 |
| 2 | 固定收益投资 | 505,907,780.50 | 83.69 |
| | 其中:债券 | 505,907,780.50 | 83.69 |
| | 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 | 53,684,731.22 | 8.88 |
| 6 | 其他资产 | 11,430,882.94 | 1.89 |
| 7 | 合计 | 604,495,362.19 | 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 | 21,781,650.89 | 3.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | 1,356,800.00 | 0.24 |
| F | 批发和零售业 | 1,420,572.00 | 0.25 |
| 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 | 2,767,944.64 | 0.49 |
| J | 金融业 | 4,173,000.00 | 0.74 |
| K | 房地产业 | 1,972,000.00 | 0.35 |
| 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 | 33,471,967.53 | 5.94 |

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 | 601318 | 中国平安 | 100,000 | 4,173,000.00 | 0.74 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 80,000 | 3,126,400.00 | 0.55 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 60,235 | 3,011,750.00 | 0.53 |
| 4 | 600588 | 用友软件 | 199,996 | 2,767,944.64 | 0.49 |
| 5 | 600309 | 万华化学 | 130,000 | 2,691,000.00 | 0.48 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 70,000 | 2,339,400.00 | 0.41 |
| 7 | 002648 | 卫星石化 | 79,970 | 2,317,530.60 | 0.41 |
| 8 | 600315 | 上海家化 | 50,000 | 2,111,500.00 | 0.37 |
| 9 | 000006 | 深振业A | 400,000 | 1,972,000.00 | 0.35 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 50,000 | 1,633,000.00 | 0.29 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 6,876,141.00 | 1.22 |
| 2 | 央行票据 | - | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | 39,172,000.00 | 6.95 |
| | 其中:政策性金融债 | 39,172,000.00 | 6.95 |
| 4 | 企业债券 | 88,811,000.00 | 15.75 |
| 5 | 企业短期融资券 | 250,363,000.00 | 44.41 |
| 6 | 中期票据 | 50,215,000.00 | 8.91 |
| 7 | 可转债 | 70,470,639.50 | 12.50 |
| 8 | 其他 | - | 0.00 |
| 9 | 合计 | 505,907,780.50 | 89.73 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1182106 | 11海螺集MTN1 | 500,000 | 50,215,000.00 | 8.91 |
| 2 | 041351012 | 13雅善江CP001 | 500,000 | 50,025,000.00 | 8.87 |
| 3 | 112028 | 11冀能债 | 400,000 | 39,700,000.00 | 7.04 |
| 4 | 041358013 | 13友谊CP001 | 300,000 | 30,129,000.00 | 5.34 |
| 5 | 041369006 | 13张江CP001 | 300,000 | 30,063,000.00 | 5.33 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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;

1.根据中国平安投票发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告,该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司(以下简称"万福生科")发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

在上述公告公布后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

2.上海家化联合股份有限公司("上海家化")于2013年11月21日发布《关于收到中国证监会<调查通知书>的公告》,称公司于2013年11月20日公司收到中国证券监督管理委员会(调查通知书)(编号:沪调查通字2013-1-64号),因公司涉嫌未按规定披露信息,中国证券监督管理委员会决定对上海家化立案稽查。本基金投资上海家化的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上海家化受调查事件进行了及时分析和跟踪研究,认为该调查不会对上海家化投资价值构成实质性负面影响。

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(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 263,309.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | 288,373.71 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,877,218.88 |
| 5 | 应收申购款 | 1,980.64 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,430,882.94 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 16,136,819.20 | 2.86 |
| 2 | 110023 | 民生转债 | 9,653,000.00 | 1.71 |
| 3 | 110018 | 国电转债 | 6,189,000.00 | 1.10 |
| 4 | 113003 | 重工转债 | 5,079,542.70 | 0.90 |
| 5 | 113001 | 中行转债 | 4,816,500.00 | 0.85 |

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未存在流通受限情况。

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 587,141,773.34 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 736,213.52 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 45,233,953.78 |
| 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 | 542,644,033.08 |

### §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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

### §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保本混合型证券投资基金的文件;

2.《大成保本混合型证券投资基金基金合同》;

3.《大成保本混合型证券投资基金基金托管协议》;

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

本季度报告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
2014年1月22日

# 大成标普500等权重指数证券投资基金

## 2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年1月22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2014年1月20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10月1日起至12月31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 | 87,946,838.33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。<br>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(2013年10月1日-2013年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 2,003,117.52 |
| 2.本期利润 | 8,422,160.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0942 |
| 4.期末基金资产净值 | 112,471,930.60 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.279 |

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。

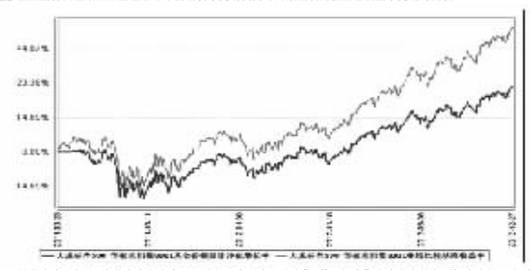
3.2 基金净值表现

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 | 7.93% | 0.66% | 9.85% | 0.68% | -1.92% | -0.02% |

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。

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4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,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%的仅有1笔,原因为投资策略需要;公司旗下主动投资组合间存在1笔债券同日反向交易,原因为投资策略需要;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4季度,发达国家经济增长动力进一步增强,美国尤为突出。

4季度美国宏观经济数据继续表现强劲,前期发生的美国政治僵局已经获得解决,未来不会继续对宏观经济造成严重的影响。ISM指数创出了2012年以来的新高,显示了制造业的持续回暖;最新公布的3季度美国GDP季环比年化增长率更是高达4.1%,远超潜在增长水平。本季度经济增长的主要动力来自于企业的补库存行为,同时个人消费支出依然稳健增长。较好的经济数据推动力股市的进一步上涨,美国主要股指在本季度继续创出了历史新高。

基于逐步改善的经济增长状况,美联储已经开始缩减量化宽松政策,但是缩减的步伐慢于市场预期。同时,投资者也逐步建立了美联储将会逐步退出量化宽松政策的预期,因此美联储宣布缩减量化宽松政策并未对资产市场造成严重的负面影响。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨9.85%,美元兑人民币中间价下跌0.83%,经汇率调整后的目标指数上涨8.94%。在本报告期内,本基金净值上涨7.93%,低于经汇率调整后的目标指数1.01%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为0.64%,日均偏差绝对值为0.035%,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1.279元,本报告期基金份额净值增长率为7.93%同期业绩比较基准收益率9.85%,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2014年,美国宏观经济有望加速增长。经济增长的来源依然在于个人消费的持续增加和住宅市场的持续回暖,同时企业投资有望快速增加,进一步推动经济增长。

美国各级政府在2012年及2013年持续减少支出,这对此前两年的经济增长造成了一定的负面影响。而在2014年,政府削减支出对宏观经济的影响会比前两年减少。

美联储在2014年有可能持续削减量化宽松政策的规模,但是美联储的政策出发点是不对经济造成严重的负面影响,因此不会拖累宏观经济。同时,美联储仍将在很长一段时间内保持极低利率,这将保证经济增长。

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 | 105,853,653.46 | 91.29 |
| | 其中:普通股 | 105,853,653.46 | 91.29 |
| | 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 | 9,287,850.70 | 8.01 |
| 8 | 其他资产 | 812,174.80 | 0.70 |
| 9 | 合计 | 115,953,678.96 | 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 | 105,853,653.46 | 94.12 |
| 合计 | 105,853,653.46 | 94.12 |

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(%) |
|---|---|---|
| 消费者非必需品 | 17,567,092.83 | 15.62 |
| 金融 | 17,252,507.50 | 15.34 |
| 信息技术 | 14,052,918.40 | 12.49 |
| 工业 | 13,721,111.42 | 12.20 |
| 医疗保健 | 11,630,041.14 | 10.34 |
| 能源 | 9,073,504.05 | 8.07 |
| 消费者常用品 | 8,348,652.31 | 7.42 |
| 基础材料 | 6,691,698.19 | 5.95 |
| 公用事业 | 6,299,439.47 | 5.60 |
| 电信服务 | 1,216,688.15 | 1.08 |
| 合计 | 105,853,653.46 | 94.12 |

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 | LSI Corporation | LSI公司 | LSI UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 4,028 | 270,632.61 | 0.24 |
| 2 | Textron Inc | 德事隆公司 | TXT UN | 纽约交易所 | 美国 | 1,111 | 248,999.59 | 0.22 |
| 3 | Quanta Services Inc | Quanta服务股份有限公司 | PWR UN | 纽约交易所 | 美国 | 1,267 | 243,793.81 | 0.22 |
| 4 | Red Hat Inc | 红帽公司 | RHT UN | 纽约交易所 | 美国 | 713 | 243,610.91 | 0.22 |
| 5 | McGraw Hill Financial Inc | 麦格希公司 | MHFI UN | 纽约交易所 | 美国 | 507 | 241,726.23 | 0.21 |
| 6 | Discovery Communications Inc | 探索传播公司 | DISCA UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 437 | 240,910.10 | 0.21 |
| 7 | Ryder System Inc | Ryder系统公司 | R UN | 纽约交易所 | 美国 | 535 | 240,658.67 | 0.21 |
| 8 | Gannett Co Inc | 甘乃特公司 | GCI UN | 纽约交易所 | 美国 | 1,331 | 240,040.93 | 0.21 |
| 9 | Monster Beverage Corp | 怪兽饮料公司 | MNST UQ | 纳斯达克交易所 | 美国 | 578 | 238,822.04 | 0.21 |
| 10 | Franklin Resources Inc | 富兰克林资源公司 | BEN UN | 纽约交易所 | 美国 | 678 | 238,638.40 | 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 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 128,843.41 |
| 5 | 应收申购款 | 307.74 |
| 6 | 其他应收款 | 683,023.65 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 812,174.80 |

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