

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2016 年第 3 季度报告
2016 年 9 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 10 月 24 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 10 月 21 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 7 月 1 日起至 9 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 | 63,527,808.36 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（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 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 320,724.49 |
| 2. 本期利润 | 2,908,806.95 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0539 |
| 4. 期末基金资产净值 | 97,889,624.57 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.541 |

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。

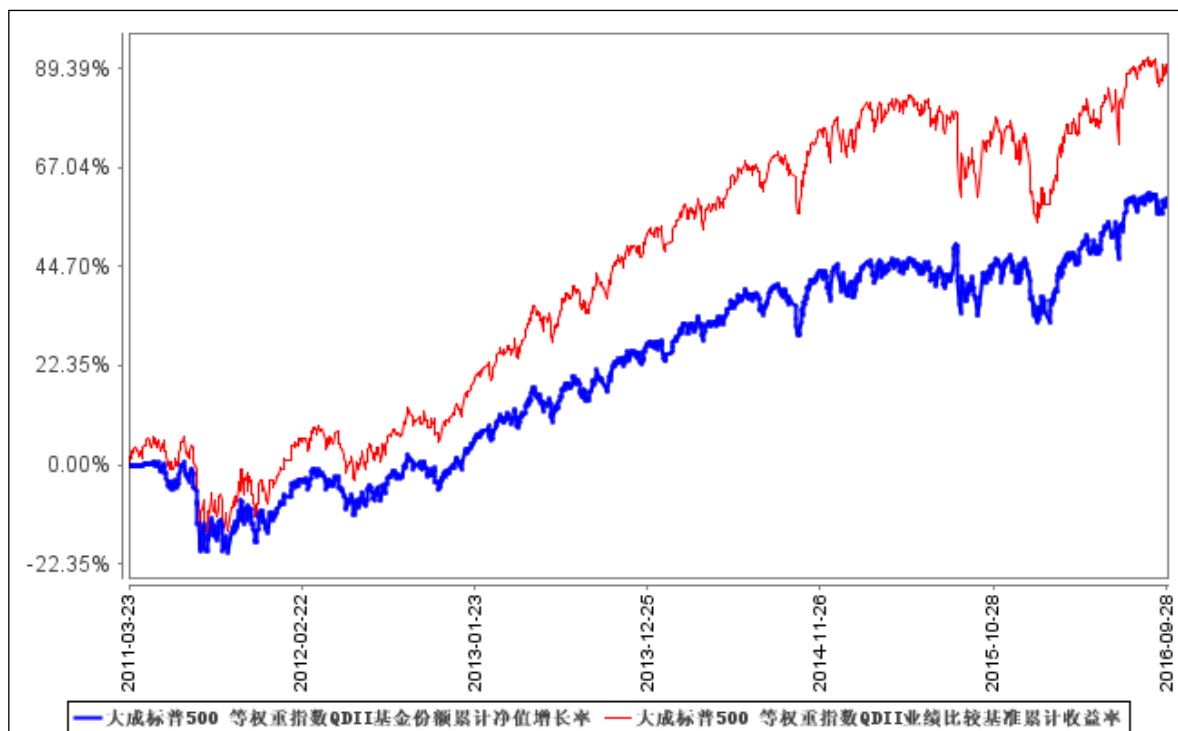
3.2 基金净值表现

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 | 4.33% | 0.71% | 4.52% | 0.72% | -0.19% | -0.01% |

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合规守信情况说明

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。2016 年 3 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

合同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 3 季度，国际经济局势相较上一季度来说更为平稳。在 6 月底，英国公投“脱离欧盟”后，欧洲局势相对平稳，但英镑出现了持续的贬值。日本央行维持负的银行超额准备金利率并引入新的货币政策框架，以期实现对于长期利率的调控。

尽管欧洲和日本的经济依然低迷，但美国宏观经济在 3 季度仍然保持了平稳增长。美国政府于 9 月底公布的 2 季度 GDP 年化环比增长率为 1.4%，虽然增速并不强劲，但仍然维持了稳定的正增长并高于 1 季度的经济增速。在 GDP 的分项组成中，个人消费保持了年化 4.3% 的增长速度，这意味着美国经济仍然保持着较为健康的水平。美国劳动力市场保持强势，失业率保持低水平，而平均就业增长保持稳健。

近期美国制造业 PMI 指数出现了下滑，这意味着美国制造业陷入了短期的低谷。但最新数据显示费城联储制造业 PMI、新宅开工最新数据等都呈现出积极的态势，这意味着 4 季度制造业有复苏的希望。

9 月份美联储公开市场委员会会议后，美联储宣布将联邦基金利率目标区间维持在 0.25%-0.50% 的水平，符合之前市场的一致预期，但会议措辞比 7 月更显鹰派。相比 7 月份报告，9 月份的报告修改经济增长温和扩展为经济增长已经复苏，报告还表示近期经济温和增长，劳动力市场继续走强，但固定投资和低迷的通胀增速是薄弱环节。

我们预计，如果未来不发生重大变化，今年 12 月份美联储会加息一次，但加息不会拖累美股的长期表现。

3 季度，本基金的标的指数创出历史新高，同期美元相对于人民币继续保持小幅升值的趋势，这都有利于本基金净值的表现。

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 1.541 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.33%，同期业绩比较基准收益率为 4.52%，低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 | 91,330,375.64 | 90.01 |
| | 其中：普通股 | 91,330,375.64 | 90.01 |
| | 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 | 8,565,483.10 | 8.44 |
| 8 | 其他资产 | 1,574,022.22 | 1.55 |
| 9 | 合计 | 101,469,880.96 | 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 | 91,330,375.64 | 93.30 |
| 合计 | 91,330,375.64 | 93.30 |

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 | 14,840,386.64 | 15.16 |
| 工业 | 12,384,104.42 | 12.65 |

| | | |
|--------|---------------|-------|
| 信息技术 | 12,327,562.85 | 12.59 |
| 金融 | 11,574,617.97 | 11.82 |
| 医疗保健 | 10,755,162.89 | 10.99 |
| 能源 | 6,782,274.26 | 6.93 |
| 消费者常用品 | 6,494,926.44 | 6.63 |
| 房地产 | 5,106,351.26 | 5.22 |
| 公用事业 | 5,068,197.52 | 5.18 |
| 基础材料 | 4,937,128.57 | 5.04 |
| 电信服务 | 1,059,662.82 | 1.08 |
| 合计 | 91,330,375.64 | 93.30 |

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 | Skyworks Solutions Inc | 思佳讯 解决方案 公司 | SWKS UQ | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 414 | 210,497.34 | 0.22 |
| 2 | QUALCOMM Inc | 高通公 司 | QCOM UQ | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 460 | 210,417.48 | 0.21 |
| 3 | Western Digital Corp | 西部数 据公司 | WDC UQ | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 529 | 206,548.56 | 0.21 |
| 4 | National Oilwell Varco Inc | 美国国 民油井 | NOV UN | 纽约交 易所 | 美国 | 834 | 204,615.54 | 0.21 |
| 5 | Caterpillar Inc | 卡特彼 勒 | CAT UN | 纽约交 易所 | 美国 | 345 | 204,511.97 | 0.21 |
| 6 | HP Inc | 惠普 | HPQ UN | 纽约交 易所 | 美国 | 1,967 | 203,990.16 | 0.21 |
| 7 | Nvidia Corp | 英伟达 公司 | NVDA UQ | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 444 | 203,157.91 | 0.21 |
| 8 | E*TRADE Financial Corp | 亿创证 券有限 公司 | ETFC UQ | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 1,042 | 202,624.75 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------|--------|--------|-------|----|-----|------------|------|
| 9 | CSX Corp | CSX 公司 | CSX UN | 纽约交易所 | 美国 | 992 | 202,043.52 | 0.21 |
| 10 | Cummins Inc | 康明斯 | CMI UN | 纽约交易所 | 美国 | 236 | 201,959.38 | 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 | 107,120.06 |
| 4 | 应收利息 | 819.24 |
| 5 | 应收申购款 | 1,408,534.50 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 57,548.42 |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 1,574,022.22 |
|---|----|--------------|

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 | 43,715,505.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 30,046,183.59 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 10,233,880.82 |
| 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 | 63,527,808.36 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响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 10 月 24 日