

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 26 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 2021 年 07 月 01 日起至 09 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
基金主代码	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	169,400,362.46 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

境外资产托管人	英文名称: Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文名称: 中国银行(香港)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(2021年7月1日-2021年9月30日)
1. 本期已实现收益	6,523,079.58
2. 本期利润	-959,575.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0058
4. 期末基金资产净值	372,203,646.41
5. 期末基金份额净值	2.197

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、根据 2021 年 9 月 4 日基金管理人披露的《大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增设基金份额并修订基金合同、托管协议的公告》,自 2021 年 9 月 7 日起大成标普 500 等权重指数证券投资基金增加美元基金份额。截至本报告期末,本基金美元份额无份额持有人。

3.2 基金净值表现

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

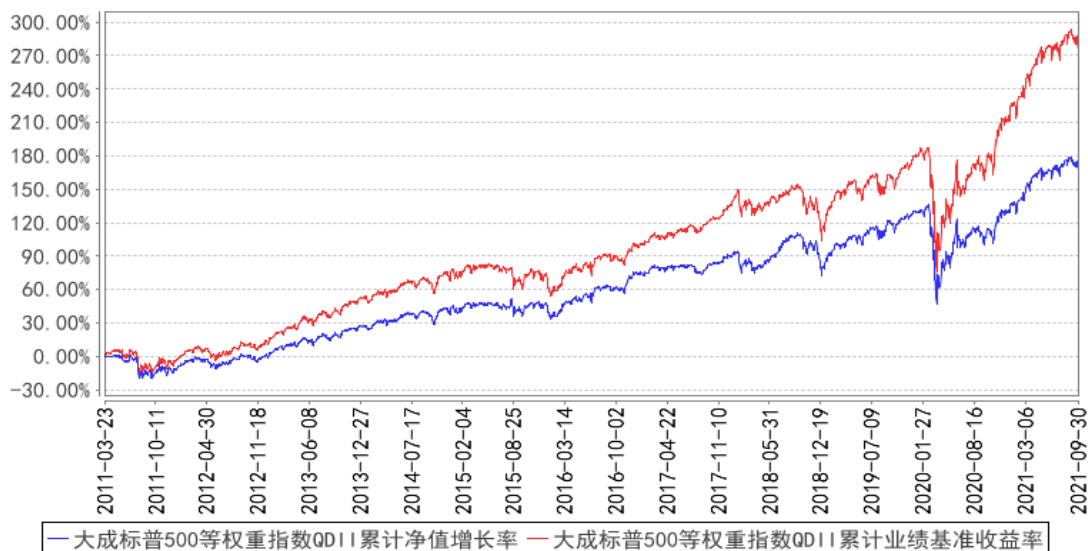
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.18%	0.73%	-0.22%	0.75%	0.04%	-0.02%
过去六个月	4.12%	0.75%	6.66%	0.76%	-2.54%	-0.01%
过去一年	29.58%	0.96%	40.87%	1.01%	-11.29%	-0.05%
过去三年	28.01%	1.54%	49.30%	1.62%	-21.29%	-0.08%
过去五年	65.08%	1.26%	97.73%	1.31%	-32.65%	-0.05%
自基金合同	167.69%	1.14%	275.89%	1.20%	-108.20%	-0.06%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

大成标普500等权重指数QDII累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	本基金基金经理	2011年8月26日	—	18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，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理，现任国际业务部基金经理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起任大成

					<p>恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日至2020年7月7日任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)基金经理。2021年5月18日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2021年9月9日起任大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

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

无。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3日、5日、10日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理

交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 2 笔同日反向交易，原因为组合合规比例调整。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% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 4 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2021 年 3 季度，美国宏观经济表现较佳，主要美股指数也都创出了历史新高。

从最重要的宏观数据来看，最新公布的美国 2021 年 2 季度的 GDP 环比折年率为 6.7%，保持在高速增长的区间。从 PMI 指数来看，9 月 ISM 制造业指数为 61.1，ISM 非制造业指数为 61.9，都处于高度繁荣的区间，且比上月还有提升，表明美国供给端持续保持繁荣。从劳动力市场数据来看，失业率已经降至 4.8%，已经基本回到充分就业的水平区间。较繁荣的劳动力市场也支持了个人收入的持续增长，从而进一步促进了个人消费的提升。

在这种非常好的宏观环境下，企业盈利也取得了高速增长。从最新公布的美股上市公司二季度财报整体来看，业绩较好，且较多权重股公司的二季度利润同比增幅超过 50%。

今年 7、8 月份开始美国出现了新一轮的新冠疫情，疫情至 9 月初达到顶峰，并小幅的影响了宏观经济数据，但最近这波疫情开始得到缓解，新增感染人数逐步降低。

近期美国的通胀水平有所提高，最近几个月的 CPI 都超过了 5%。偏高的通胀水平致使美联储缩减量化宽松政策箭在弦上。美联储公布的 9 月份公开市场委员会会议纪要显示，美联储将继续将基准利率维持在 0-0.25% 不变，每月购买资产规模仍为 1200 亿美元不变，但是，美联储称“如果进展大致如预期，则资产购买步伐可能很快就会放缓”，这意味着缩减量化宽松政策箭在弦上。从对经济增长的预测方面来看，美联储对于长期经济增长乐观。美联储预期 2021 年 GDP 增长 5.9%，低于今年 6 月预期 7.0%；但将明年和后年的经济增速分别上调 0.5 和 0.1 个百分点至 3.8% 和 2.5%。这表明美联储认为经济增长短期受本轮疫情影响有所下调，但疫情只改变复苏的节奏，不影响复苏的趋势，对明年经济增长较为乐观。

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。

截至本报告期末本基金份额净值为 2.197 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.18%，业绩比较基准收益率为-0.22%。

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	349,966,570.73	92.61
	其中：普通股	349,966,570.73	92.61
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,208,057.56	6.94
8	其他资产	1,697,856.79	0.45
9	合计	377,872,485.08	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	349,966,570.73	94.03
合计	349,966,570.73	94.03

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	46,808,439.32	12.58
通信服务	16,304,643.29	4.38
房地产	20,240,305.36	5.44
能源	16,958,753.52	4.56
公用事业	18,997,902.74	5.10
非日常生活消费品	43,440,411.21	11.67
工业	50,338,527.62	13.52
日常消费品	22,246,357.32	5.98
信息技术	51,787,940.58	13.91
医疗保健	43,529,145.21	11.69
原材料	19,314,144.56	5.19
合计	349,966,570.73	94.03

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

无。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金 融股份有 限公	RJF UN	美国纽 约证券 交易所	美国	1,627	973,715.10	0.26
2	DIAMONDBA CK ENERGY INC	Diamondba ck 能源股 份有限公 司	FANG UQ	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,474	904,995.93	0.24
3	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	美国纽 约证券 交易所	美国	3,816	878,811.65	0.24
4	CF INDUSTRIE S HOLDINGS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	CF UN	美国纽 约证券 交易所	美国	2,424	877,524.43	0.24

5	MARATHON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	9,818	870,418.89	0.23
6	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,648	857,920.88	0.23
7	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	6,040	852,378.72	0.23
8	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	4,429	849,651.09	0.23
9	SVB FINANCIAL GROUP	硅谷银行金融集团	SIVB UQ	纳斯达克 证券 交易所	美国	198	830,664.56	0.22
10	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国 纽约 证券 交易所	美国	1,632	826,729.74	0.22

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

无。

5.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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是否出现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

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、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	360,847.83
4	应收利息	785.65
5	应收申购款	1,275,198.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	61,024.74
8	其他	-
9	合计	1,697,856.79

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

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	162,070,331.12
报告期期间基金总申购份额	40,385,974.87
减：报告期期间基金总赎回份额	33,055,943.53
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	169,400,362.46

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况**

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 9 月 3 日，召开公司 2021 年第四次临时股东会审议通过选举陈勇先生担任公司股东监事，许国平先生不再担任公司股东监事、监事会主席；

2021 年 9 月 3 日，召开公司第七届监事会第六次会议审议通过选举陈勇先生担任公司第七届监事会主席。

§ 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、本报告期内在规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

2021 年 10 月 27 日