

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:2014年3月29日

#### § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员不存在虚假记载、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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由监事会签发。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27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。

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及其更新。

本年度报告摘要除年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资人可以查阅。

本报告期自2013年01月01日至2013年12月31日止。

#### § 2 基金简介

基金简称	大成标普500等权重指数QDII
基金代码	1609001
交易代码	1609001
基金运作方式	契约型开放式
基金首次募集日	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
报告期末基金资产总额	87,946,838.33元
报告期末基金份额净值	不适用

#### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成标普500等权重指数QDII
基金代码	1609001
交易代码	1609001
基金运作方式	契约型开放式
基金首次募集日	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
报告期末基金资产总额	87,946,838.33元
报告期末基金份额净值	不适用

#### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投信纪律和多层次风险管理手段，实现基金投资组合的长期稳定增值，追求超越标的指数的收益。
投资策略	本基金将遵循标的指数的构成规则及指数构造方法，投资于股票、债券、现金等金融工具，以期获得与标的指数相类似的回报。但因标的指数的构成规则及指数构造方法的限制，本基金可能无法完全复制标的指数，即存在跟踪误差。
业绩比较基准	标准普尔500指数(人民币)
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金资产主要投资于股票，具有较高的风险和收益。

#### 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
法定代表人	陈鹤明	唐建农
信息披露负责人	陈鹤明	唐建农
联系电话	0755-83183388	95566
电子邮箱	dscg@fundchina.com	fundcbank@china.com
客户服务电话	4008855358	95566
传真	0755-83195988	010-66594942

#### 2.4 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
地址	中国银行(香港)有限公司
邮编	香港花园道1号恒生大厦
办公地址	中国银行(香港)有限公司
邮编	香港花园道1号恒生大厦

#### 2.5 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道7088号招行银行大厦32层大成基金管理有限公司客户服务部

#### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

##### 3.1 主要会计数据和财务指标

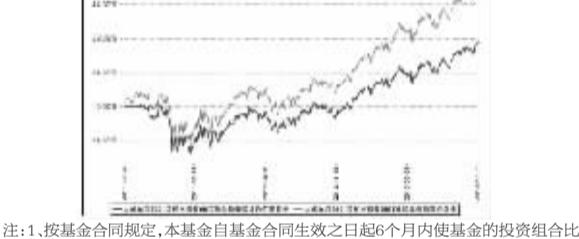
金额单位:人民币元

项目	2013年	2012年	2011年3月23日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	5,397,706.62	79,108.71	-1,161,876.30
本期利润	23,522,175.77	17,108,874.66	-18,824,16.98
加权平均基金份额利润	0.2737	0.1343	-0.0747
本期基金份额净值增长率	27.26%	13.82%	-1.76%
3.1 期末可供分配基金份额利润	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0480	-0.0162	-0.1174
期末基金资产净值	112,471,938.60	97,933,873.07	132,794,671.01
期末基金份额净值	1.279	1.005	0.883

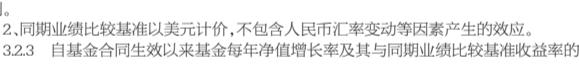
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除非费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2、所涉基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

##### 3.2 净值表现

###### 3.2.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

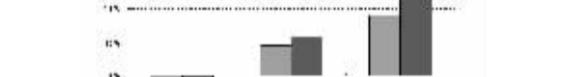


注:1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。  
2、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。  
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比



注:1、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,建仓期结束时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。  
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比

##### 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:1、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,建仓期结束时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。  
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比

##### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比

##### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

#### § 4 管理人报告

##### 4.1 基金管理人及基金经理的情况

###### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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,是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一,注册资本为人民币1亿元人民币,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(40%)、光大证券投资基金管理有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券投资基金公司(5%)。截至2013年12月31日,本基金管理公司以只认沽式封闭基金、深证成份指数ETF、大成货币基金、大成增强型债券基金、大成蓝筹稳健基金、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、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长型证券投资基金、大成创新成长型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成增强型债券型证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成蓝筹稳健基金、大成增强型债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成稳健收益债券型证券投资基金、大成优势企业股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成货币市场基金、大成添利理财货币型证券投资基金、大成理财21天债券型发起式基金、大成现金管理场内申赎货币市场基金、大成景气成长债券型证券投资基金、大成景气兴信用货币型证券投资基金、大成景气纯债债券型证券投资基金及大成景气分级债券型证券投资基金。

###### 4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

基金管理人对报告期内本基金运作合规性等情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,在基金投资运作中,严格遵守法律法规,规范运作,没有损害基金份额持有人利益的行为,不存在内幕交易、利用未公开信息交易、操纵市场等违法违规行为,没有进行基金宣传推介和销售服务,没有违反基金销售行为规范和基金销售行为准则,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性等情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,在基金投资运作中,严格遵守法律法规,规范运作,没有损害基金份额持有人利益的行为,不存在内幕交易、利用未公开信息交易、操纵市场等违法违规行为,没有进行基金宣传推介和销售服务,没有违反基金销售行为规范和基金销售行为准则,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规性等情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,在基金投资运作中,严格遵守法律法规,规范运作,没有损害基金份额持有人利益的行为,不存在内幕交易、利用未公开信息交易、操纵市场等违法违规行为,没有进行基金宣传推介和销售服务,没有违反基金销售行为规范和基金销售行为准则,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内本基金公平交易的专项说明

根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》的规定,基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人对买卖证券的各一级市场申购、赎回价格实行同等待遇,对大宗交易、定期定额投资、组合投资、证券发行代理、信息披露等符合法律法规、行业监管规定和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有进行基金宣传推介和销售服务,没有违反基金销售行为规范和基金销售行为准则,没有损害基金份额持有人利益。

4.5 管理人对报告期内本基金公平交易的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原则和制度,对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3

# 大成标普500等权重指数证券投资基金

## 2013 年度报告摘要

日内及5日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明:债券交易同向交易频率较低,收益率相对较低,收益率差较大主要来源于市场因素(如个别当日价格幅幅较高)及组合交易策略选择,即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大,但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。

#### 4.3 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。主动型投资组合间股票交易存在11个交易日内反向交易,原因为投资策略需要。主动型投资组合与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笔交易量超过该股当日成交量5%的仅有2笔,原因为投资策略需要。投资组合间相隔交易日反向交易的市场成交占比、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 管理人对报告期内基金投资策略和运作分析

2013年,国际宏观经济形势更为稳健,全球经济持续保持小幅增长的状况,美国经济增长尤为突出。

欧洲方面看,欧洲的金融体系保持了相对的稳定,而且从下半年开始,欧洲宏观经济也有了较大的改善,开始走出衰退,缓慢增长。

美国经济更是一枝独秀。年内虽然发生了政治动荡,并一度出现部分联邦政府关门事件,但之后该问题已经得到圆满解决,且并未对宏观经济造成较大的冲击。美国宏观经济增长表现良好,美股指数更是创出了2012年以来的新高,显示了制造业的持续回暖;3季美国GDP季环比年化增长率更是高达4.1%,远超潜在增长率。本年度经济增长的主要动力来自于个人消费支出依然稳健及房地产市场的持续复苏,同时伴随着企业投资的逐步增加,较好的经济数据推动了美国股市的持续上涨,因此本基金标的指数在本年度内屡创新高。