

大成中证红利指数证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明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。

基金经理人:中建投建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值增长率和基金合同约定的其他内容。

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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 大成中证红利指数

交易代码 099010

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2010年2月2日

报告期末基金份额总额 265,755,479.46份

投资目标 通过本基金的投资程序约束和数量化风险管理手段,紧密跟踪标的指数,追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化,力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年度跟踪误差不超过4%。

投资策略 本基金将完全复制法,即按照标的指数的成份股股数,按照其在基金资产中的比例构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生变动、增发、分红等行为时,以及有其他特殊情况(如成份股停牌等)不适合完全按照标的指数的构成比例进行调整时,本基金将根据实际情况进行适当调整,以实现对标的指数的跟踪控制。

业绩比较基准 中证红利指数×95%+银行活期利率(税后)×5%

风险收益特征 本基金属于股票基金,风险与收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -15,240,359.43

2.本期利润 22,340,646.57

3.加权平均基金份额本期利润 0.0831

4.期末基金资产净值 225,626,986.45

5.期末基金份额净值 0.849

注:1.本报告期实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入,不含公允价值变动损益)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.本期基金份额净值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。

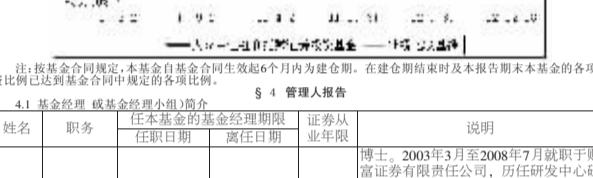
3.基金净值表现

3.1 本基金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) 准收益差(4) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 10.98% 1.18% 12.18% 1.20% -1.20% -0.02%

3.2 本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:按基金合同规定,本基金合同生效起6个月内为建仓期。在建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资比例已符合基金合同的规定。

§ 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 证件从 证书从 说明

胡琦先生 经理 2011年5月18日 8年 博士,2003年3月至2008年7月就职于财

汇金公司,2008年7月就职于中行研发中心,研

究员,现担任中行金融控股公司及以金工

利部主管投资顾问经理,2008年8月至

2010年10月在深圳证券交易所博士后工

作站从事研究工作,2010年10月加入大

成基金管理有限公司,2011年5月18日任

本基金基金经理,2011年5月15日至2012年

31日在任大成沪深300指数证券投资基金

基金经理,2011年11月8日开始担任中行

中证内地消费指数基金基金经理,经公

理,具有基金从业资格,国籍:中国。

4.2 从业人员及基金经理的诚信记录

4.3 公平交易专项说明

4.4 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.5 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.6 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.7 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.8 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.9 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.10 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.11 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.12 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.13 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.14 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.15 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.16 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.17 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.18 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.19 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.20 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.21 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.22 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.23 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.24 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.25 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.26 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.27 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.28 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.29 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.30 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.31 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.32 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.33 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.34 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.35 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.36 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.37 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.38 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.39 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.40 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.41 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.42 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.43 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.44 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.45 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.46 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.47 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.48 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.49 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.50 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.51 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.52 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.53 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.54 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.55 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.56 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.57 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.58 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.59 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.60 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.61 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.62 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.63 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.64 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.65 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.66 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.67 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.68 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.69 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.70 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.71 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.72 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.73 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.74 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.75 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.76 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.77 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.78 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.79 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.80 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.81 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.82 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.83 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.84 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.85 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.86 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.87 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.88 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.89 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.90 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.91 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.92 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.93 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.94 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.95 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.96 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.97 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.98 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.99 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.10 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.11 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.12 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.13 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.14 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.15 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.16 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.17 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.18 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.19 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.20 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.21 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.22 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.23 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.24 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.25 报告期内本基金投资组合运作情况的说明

4.26