大成保本混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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2013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2012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	766,957,704.51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)。指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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	298,256.95
2.本期利润	2,558,125.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032
4.期末基金资产净值	798,859,138.14
5.期末基金份额净值	1.042

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。

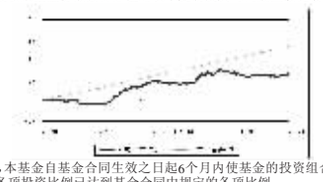
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.39%	0.06%	1.12%	0.01%	-0.73%	0.05%

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规定,截至报告日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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	-	13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室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日开始兼任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,2011年4月20日起同时兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理,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	-	11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月就职于东方保险股份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日开始担任大成保本混合型证券投资基金基金经理。2011年11月30日起担任大成可转债增强债券基金基金经理。2012年6月15日起担任大成景恒保本混合型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 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。2012年四季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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均不超过该股当日成交量5%。投资组合间不存在债券同日反向交易。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,但结合交易价差分析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

2012年四季度,在外需增加和基建投资加快的作用下,中国经济环比改善,温和复苏。工业品价格指数跌幅收敛,CPI小幅反弹。由于央行加大短期资金投放,年底流动性紧张程度低于市场预期。影子银行继续快速扩张,社会融资总量对经济的支持力度加大。与此同时,十八大召开后,经济复苏预期有所升温,市场风险偏好明显上升。资产市场上,债券市场尤其是中长期债券价格出现下跌,股票和转债等风险资产上涨明显:4季度沪深300指数上涨10.02%,中信标普可转债指数上涨4.39%。

考虑到本基金的产品特征,基于"严格风险控制,追求稳健收益"的投资原则:本基金在大类资产配置上,加大可转债资产配置,小幅增持股票资产,同时缩短固定收益类资产的组合久期,主要以国债金融债和高等级信用债券为主。

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1.042元,本报告期基金份额净值增长率为0.39%同期业绩比较基准收益率为1.12%,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

展望2013年一季度,美国财政悬崖问题有待解决,欧洲经济低速增长,外需对中国经济的拉动作用有限。但考虑到国内库存处于低位,房地产和汽车下游需求相对旺盛,政府换届后基建投资可能加速,经济增长势头有望维持。物价水平温和上升,货币政策上仍将维持宽松的流动性环境。预计现阶段的股票市场和债券市场风险不大,其中攻防兼备的可转债资产值得配置。考虑到企业盈利状况有所改善,在总体产能过剩和企业杠杆偏高的背景下,信用风险出现的概率加大。

本基金一季度将继续保持较高比例的可转债投资,适当增加基本面良好的稳定增长类股票,把握股票市场反弹带来的投资机会。同时增持部分基本面良好的高等级信用债券,以提高投资组合的持有收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益回报给投资者。

§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	16,791,420.00	2.00
	其中:股票	16,791,420.00	2.00
2	固定收益投资	717,131,853.10	85.45
	其中:债券	717,131,853.10	85.45
	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	23,000,000.00	2.74
	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	72,927,746.67	8.69
6	其他资产	9,419,172.69	1.12
7	合计	839,270,192.46	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	采掘业	-	0.00
C	制造业	4,681,620.00	0.59
C0	食品、饮料	2,299,220.00	0.29
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	0.00
C8	医药、生物制品	2,382,400.00	0.30
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	6,809,800.00	0.85
J	房地产业	5,300,000.00	0.66
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	16,791,420.00	2.10

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	120,000	5,434,800.00	0.68
2	600383	金地集团	600,000	4,212,000.00	0.53
3	600267	海正药业	160,000	2,382,400.00	0.30
4	600519	贵州茅台	11,000	2,299,220.00	0.29
5	600036	招商银行	100,000	1,375,000.00	0.17
6	600048	保利地产	80,000	1,088,000.00	0.14

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	8,990,784.00	1.13
2	央行票据	19,974,000.00	2.50
3	金融债券	218,070,000.00	27.30
	其中:政策性金融债	218,070,000.00	27.30
4	企业债券	248,609,916.00	31.12
5	企业短期融资券	50,370,000.00	6.31
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	171,117,153.10	21.42
8	其他	-	0.00
9	合计	717,131,853.10	89.77

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	113001	中行转债	1,315,640	126,761,914.00	15.87
2	126011	08石化债	1,130,000	108,480,000.00	13.58
3	120414	12农发14	700,000	69,160,000.00	8.66
4	041261008	12中电投CP001	500,000	50,370,000.00	6.31
5	122092	11大秦01	500,000	50,230,000.00	6.29

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 投资组合报告附注

5.8.1 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、处罚的情形。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	83,333.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,245,298.41
5	应收申购款	90,540.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,419,172.69

5.8.4 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	113001	中行转债	126,761,914.00	15.87
2	110015	石化转债	44,355,239.10	5.55

5.8.5 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	841,002,020.97
本报告期基金总申购份额	1,043,757.01
减:本报告期基金总赎回份额	75,088,073.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	766,957,704.51

§7 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。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

8.3 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
2013年1月19日

大成标普500等权重指数证券投资基金

【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2013年1月18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2012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	97,408,937.82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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-336,808.85
2.本期利润	769,779.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076
4.期末基金资产净值	97,933,873.07
5.期末基金份额净值	1.005

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。

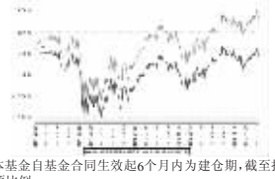
3.2 基金净值表现

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	0.80%	0.75%	2.82%	0.79%	-2.02%	-0.04%

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,截至报告日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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	8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等权重指数型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。2012年四季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。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均不超过该股当日成交量5%。投资组合间不存在债券同日反向交易。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

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年4季度,欧洲主权债务危机进一步缓解。在欧洲各国政府及欧洲央行的持续努力下,欧洲金融系统的紧张局面得以持续缓解,欧洲主要风险国家的国债收益率也出现持续下降的态势。可是,欧洲的宏观经济在2012年4季度还是出现持续的轻微衰退的情形。

2012年4季度,美国的宏观经济状况明显好于欧洲。美国的失业率进一步下降,显示劳动力市场继续改善;美国的住宅销售持续增加,显示住宅市场继续回暖;其他众多宏观经济指标也有较佳的表现。在4季度,美国财政悬崖曾经引起了股票市场的波动,但最后依然得到了解决。

在本报告期内,本基金的目标指数上涨2.82%,美元兑人民币中间价下跌0.88%,本基金净值上涨0.80%,低于经汇率调整后的目标指数1.11%。在本报告期内,本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为1.11%,日均偏差绝对值为0.055%,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1.005元,本报告期基金份额净值增长率为0.80%同期业绩比较基准收益率为2.82%,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2013年1季度,欧元区爆发较大金融风险的可能性相对较小,但意大利的选举带来的政治格局变动有可能会影响其经济改革的进程,有可能会给欧洲金融市场造成一定的波动。但是综合来看,欧洲主权债务危机的最坏时期正在过去。

展望2013年1季度,美国宏观经济有望持续保持增长。主要经济增长点大概有以下几个方面:①)消费支出继续增加;②)住房市场明显复苏;③)工业活动稳步扩张。由于核心通胀率仍保持较低的水平,美联储的量化宽松政策仍会保持,这也有望对实体经济及金融市场都产生一定程度的正面影响。

但是,美国经济也面临一定的风险。首先,虽然2012年底的美国财政悬崖问题虽然得到解决,但是美国政府仍然需要逐步减少财政支出,这会对经济造成小幅的负面影响。其次,在2013年1季度,美国还要面对重新核定债务上限的任务,其过程如果比较曲折,则将会给资本市场带来波动。

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,继续深入研究更为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	92,182,351.63	91.45
	其中:普通股	92,182,351.63	91.45
	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	8,454,928.95	8.39
8	其他资产	162,921.76	0.16
9	合计	100,800,202.34	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	92,182,351.63	94.13
合计	92,182,351.63	94.13

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 报告期末按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	15,141,144.93	15.46
消费者非必需品	15,127,333.36	15.45
信息技术	12,858,780.44	13.13
工业	11,215,616.37	11.45
医疗保健	9,556,713.47	9.76
能源	7,831,663.39	8.00
消费者常用品	7,640,770.60	7.80
基础材料	5,689,108.00	5.81
公用事业	5,678,197.24	5.80
电信服务	1,443,023.83	1.47
合计	92,182,351.63	94.13

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权益投资明细

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	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所集团	NYX UN	纽约交易所	美国	1,235	244,832.17	0.25
2	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	美国	2,632	214,237.50	0.22
3	FLIR Systems Inc	FLIR系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,493	209,362.65	0.21
4	MeadWestvaco Corp	MeadWestvaco公司	MWV UN	纽约交易所	美国	1,021	204,525.58	0.21
5	Cliffs Natural Resources Inc	克里夫斯自然资源股份有限公司	CLF UN	纽约交易所	美国	843	204,316.97	0.21
6	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	美国	653	204,154.42	0.21
7	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	1,839	202,398.69	0.21
8	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	2,329	202,163.62	0.21
9	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	640	201,779.64	0.21
10	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	2,761	201,309.48	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权益投资明细

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	103,766.75
4	应收利息	295.32
5	应收申购款	58,859.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,921.76

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

本报告期期初基金份额总额	120,478,088.45
本报告期基金总申购份额	4,570,883.08
减:本报告期基金总赎回份额	27,640,033.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	97,408,937.82

§7 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。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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。

8.3 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
2013年1月19日

国泰6个月短期理财债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月16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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|