

大成标普500等权重指数证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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:2012年7月20日

基金管理人为重要当事人,本基金根据本报告所载资料存续期限,该等性质或重大遗漏,并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别和连带责任。

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2012年7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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同生效日 2011年3月23日

报告期基金份额总额 131,452,444.92份

投资目标 通过严控的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现本基金投资组合目标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。

投资策略 本基金将按照目标指数的成份股及权重构建基金股票投资组合,并根据指数的成份股及权重的变动而进行相应调整(如股票停牌、停牌、流动性不足)导致无法获得足够数据的股票,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的调整。

本基金还将可能一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的基金,上市交易基金,以优化投资组合的建构,达到更好的交易成本和有追效指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 本基金为股票型证券投资基金,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

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 -

§ 2 基金产品概况

基金简称 大成标普500等权重指数QDII

交易代码 090001

基金运作方式 约契型开放式

基金合同生效日 2011年3月23日

报告期基金份额总额 131,452,444.92份

投资目标 通过严控的投资纪律约束和数量化风险管理手段,实现本基金投资组合目标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。

投资策略 本基金将按照目标指数的成份股及权重构建基金股票投资组合,并根据指数的成份股及权重的变动而进行相应调整(如股票停牌、停牌、流动性不足)导致无法获得足够数据的股票,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的调整。

本基金还将可能一定比例的基金资产投资于与标普500等权重指数相关的基金,上市交易基金,以优化投资组合的建构,达到更好的交易成本和有追效指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 本基金为股票型证券投资基金,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

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4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 560,206.82

2.本期利润 -5,005,645.33

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0374

4.期末基金份额净值 124,374,248.00

5.期末基金份额净值 0.941

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.1 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.67% 1.03% -4.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同业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收益。

3.2.2 本基金收益率为基金资产累计净值增长率减去同期人民币汇率变动率后的净值增长率。

3.3.1 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4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 560,206.82

2.本期利润 -5,005,645.33

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0374

4.期末基金份额净值 124,374,248.00

5.期末基金份额净值 0.941

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.1 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.67% 1.03% -4.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同业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收益。

3.2.2 本基金收益率为基金资产累计净值增长率减去同期人民币汇率变动率后的净值增长率。

3.3.2 重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4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 560,206.82

2.本期利润 -5,005,645.33

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0374

4.期末基金份额净值 124,374,248.00

5.期末基金份额净值 0.941

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.1 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%

注:1.本期已实现收益加上本期公允价值变动收益、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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金基金净值不包括持有大额资金的各费用,以费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.66% 0.09% 1.13% 0.01% 0.53% 0.08%