

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、基金托管人及基金注册登记机构承诺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、勤勉尽责的原则履行义务,但是无法保证基金一定盈利,也无法保证基金资产不受损失。
基金的投资有风险,投资者投资于本基金可能承担波动性赎回或变现风险。投资者应认真阅读并充分理解本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。
本报告自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况
大成标普500等权重指数QDII
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
131,452,442.92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。

业绩比较基准
标普500等权重指数(全收益指数)
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。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

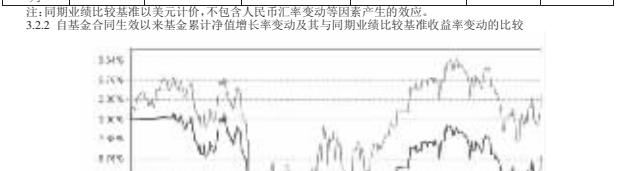
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

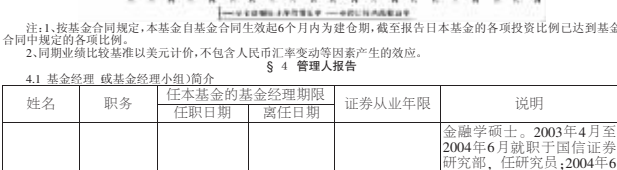
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

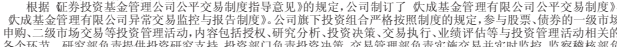
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

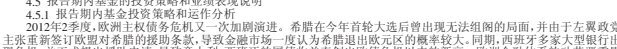
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

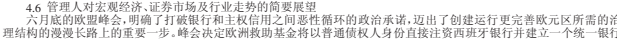
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

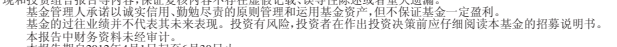
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

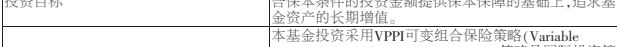
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

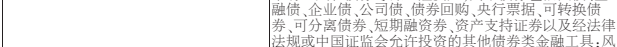
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

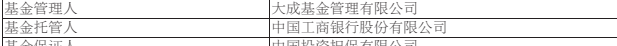
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

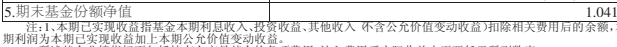
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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



监管系统。同时,希腊的非官方政党也正式成功组阁。从这些政治上的事件展示了欧洲国家在扩大欧元区稳定的决心,欧洲国家在欧元区国家中占据主导地位,因此,中期内欧元区国家在欧元区国家中的地位将更加重要。

美国的经济数据显示出美国的增长速度已经放缓,但是美国在欧元区国家之外的实体经济各部门的资产负债表都比较好,这为美国在欧元区国家中的地位提供了支持。因此,在欧元区国家之外,美国的经济仍然有实现正增长。

本基金为被动型指数基金,其投资目标是复制标的指数的收益率。本基金基金资产的投资范围包括股票、债券、货币市场工具、衍生品等,本基金基金资产的投资范围包括股票、债券、货币市场工具、衍生品等。

§ 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 117,101,196.45 93.30
其中:普通股 117,101,196.45 93.30

2 固定收益投资 0.00
其中:债券 0.00
资产支持证券 0.00

3 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

4 买入返售金融资产 0.00
其中:买入返售金融资产 0.00

5 货币市场工具 0.00
其中:货币市场工具 0.00

6 银行存款和结算备付金合计 8,218,189.05 6.55

7 其他资产 1,995,951.03 1.54

8 其他资产 195,889.32 0.16

9 合计 125,515,274.82 100.00

5.2 报告期末在不同国家、地区证券市场的股票及存托凭证投资分布

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产净值比例(%)
1 权益投资 117,101,196.45 94.15
其中:普通股 117,101,196.45 94.15

2 固定收益投资 0.00
其中:债券 0.00
资产支持证券 0.00

3 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

4 买入返售金融资产 0.00
其中:买入返售金融资产 0.00

5 货币市场工具 0.00
其中:货币市场工具 0.00

6 银行存款和结算备付金合计 8,218,189.05 6.55

7 其他资产 1,995,951.03 1.54

8 其他资产 195,889.32 0.16

9 合计 125,515,274.82 100.00

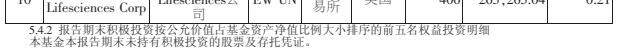
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

序号 行业名称 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)
1 金融 19,179,294.25 15.42
2 消费品 18,787,337.19 15.11
3 信息技术 16,241,334.04 13.06
4 工业 14,096,478.75 11.33
5 医疗保健 12,345,640.38 9.93
6 能源 10,375,368.43 8.34
7 消费品 9,731,922.98 7.82
8 公用事业 7,447,247.50 5.99
9 基础材料 6,986,121.00 5.62
10 电信服务 1,995,951.03 1.54
合计 117,101,196.45 94.15

注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

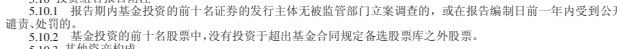
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

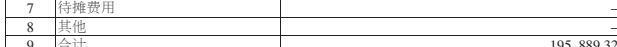
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

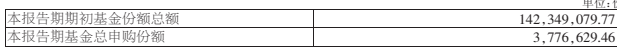
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

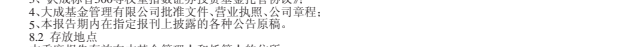
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

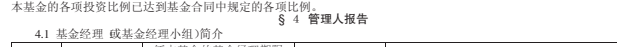
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

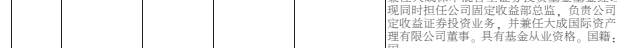
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

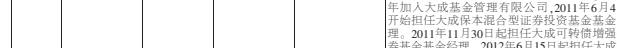
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

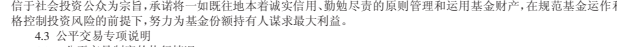
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

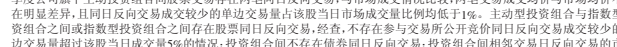
注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.67% 1.03% -0.04% 1.14% 0.37% -0.11%

注:同期业绩比较基准以美元计价,不含人民币币升值变动等因素产生的影响。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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.本基金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。
2.本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.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。

阶段 净值增长率①