

大成标普500等权重指数证券投资基金

[2012]第三季度报告

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10月25日

S1 重要提示

基金管理人就基金合同章对本基金所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容

的真实性、准确性、完整性、及时性承担法律责任。对2012年10月23日复核了本报告中的财务指

标、净值增长率和投资组合等信息，保持其复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金过往的业绩并不代表未来表现。投资者投资，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募

说明并认真阅读基金合同。

本基金报告期财务数据未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

S2 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

报告期基金份额总额:120,478,088.45份

通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段，

力争在有效控制风险的前提下获取稳定的回报。

投资目标:追求跟踪误差最小化。

本基金将按照标的指数的成份股及权重构造基金

股票投资组合，并按标的指数成份股及其权重的

变动进行相应调整。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等权重指数相关的货币基金、上市交易型基金

、以优化组合的策略，达到节约交易成本和有

效控制风险的双重目的。

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

收益水平相匹配的证券投资基金，且货币市场基金

属于风险较低的产品。

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:Bank of China (Hong Kong) Limited

注册地址:中国香港(香港)有限公司

办公地址:香港花园道1号中银大厦

邮政编码:-

S3 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7月1日 - 2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -188,819.13

2.本期利润 6,458,942.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0508

4.期末基金份额净值 120,071,704.06

5.期末基金份额净值 0.997

注:1.本期的利润指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、减去公允价值变动收益(或损失)扣除相关费用后的余额，即本期利润。2.本期已实现收益指以公允价值变动收益(或损失)扣除相关费用后的余额，即本期利润。3.期末基金份额净值不包括持有人认购基金时所发生的费用，计算时实际收益水平要低于所列数字。

4.2 本期基金份额净值增长率

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 113,616,333.76 94.62

合计 113,616,333.76 94.62

5.3 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.4 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.5 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.6 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.7 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.8 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.9 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.10 报告期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 18,269,937.49 15.22

消费者非必需品 18,023,783.96 15.01

信息技术 718,635.69 13.09

工业 13,600,967.16 11.33

医疗保健 12,344,020.08 10.28

能源 9,911,652.97 8.25

消费品耐用品 9,603,299.38 8.09

公用事业 7,259,839.56 6.05

基础材料 6,997,204.43 5.83

电信服务 1,887,177.04 1.57

合计 113,616,333.76 94.62

5.11 报告期按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公