

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  
送出日期:2016年3月26日

基金管理人的董事、董事会秘书、监事、高级管理人员、基金经理和基金经理助理及其他从事基金业务的人员不存虚假记载、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、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经二分之一以上独立董事签字同意，并由基金管理人盖章。

大成基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人诚邀您的批评、勉励及责备，投资者在中山投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其他资料。

本年度报告摘要自年度报告正式披露之日起六个月内有效。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告财务数据已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。请投资者注意阅读。

本报告期自2015年01月01日起至2015年12月31止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称 大成标普500等权重指数证券投资基金  
基金主代码 096000  
交易代码 096000  
基金运作方式 灵活配置型开放式  
基金合同生效日 2011年3月21日  
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  
报告期末基金份额总额 34,272,063.62份  
基金合同存续期间 不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标 通过严格的资产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精准跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金将按照标的指数的构成或权重由基金经理投资股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而相应地进行调整，但在特殊情况下(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时，基金经理人有权将一定比例的基金资产投资于与标的500等权重指数成分股的基金，上市交易型基金，以优化投资组合的建立，适时调整资产配置，风险控制。

业绩比较基准 标普500权重指数(美元指数)

风险收益特征 本基金在严格控制风险的前提下，力争超越标的指数的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 大成基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 王永民

信息披露负责人 袁静(电话) 0755-83116388 010-66564066

电子邮件 (tupeng@fundchina.com) kcb@fundchina.com

客户服务电话 4008886568 965660

传真 0755-83109588 010-66564042

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目 境外投资顾问 境外资产托管人

名称 Bank of China (Hong Kong) Limited

中文名称 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 -

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 <http://www.defund2000.com>

基金年度报告备置地点 深圳市福田区深南大道1008号招商银行大厦32层大成基金管理有限公司

基金年度报告备置地点 北京市西城区复兴门内大街1号中国银行股份有限公司托管业务部

3.1 主要会计数据和财务指标

基金单位:人民币元

3.1.1 利润总额和亏损总额

2015年 2014年 2013年

本期利润 -14,360,388.22 12,620,803.80 5,307,706.62

本期利润 -2,012,179.03 14,596,324.62 23,522,175.77

加权平均基金份额本期利润 0.0416 0.1481 0.2737

期末基金份额净值 1.23% 1.26% 1.21%

3.1.2 期末数和年初数

2015年末 2014年末 2013年末

本期期末基金资产净值 40,342,400.60 107,162,735.68 112,471,306.00

期末基金资产净值 49,342,400.60 107,162,735.68 112,471,306.00

基金份额本期净增值 1,440 1,426 1,279

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,本期利润为本期已实现收益减去费用。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计价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 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 份额净值增长 累计净值增长率 业绩比较基准 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 6.10% 5.04% 1.18% 1.15% -0.03%

过去二个月 1.91% 1.17% -2.39% 1.22% 4.80% -0.05%

过去一年 2.30% 1.00% -2.20% 1.22% 4.55% -0.22%

过去三年 46.78% 0.62% 62.45% 0.98% -0.67% -0.03%

过去五年 46.51% 1.03% 71.33% 1.09% -26.42% -0.06%

成立以来至今 71.33% 1.09% -26.42% -0.06%

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

本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内基金的投资组合比例符合基金合同的约定,建仓结束时本基金的各类资产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价产生的收益。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3.1 利润总额和亏损总额

2015年 2014年 2013年

本期利润 -14,360,388.22 12,620,803.80 5,307,706.62

本期利润 -2,012,179.03 14,596,324.62 23,522,175.77

加权平均基金份额本期利润 0.0416 0.1481 0.2737

期末基金份额净值 49,342,400.60 107,162,735.68 112,471,306.00

基金份额本期净增值 1,440 1,426 1,279

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,本期利润为本期已实现收益减去费用。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.4 基金净值表现

3.2.5 期末资产配置情况

3.3.2 过去三年的利润分配情况

3.3.3 过去三年的利润分配情况

3.3.4 过去三年的利润分配情况

3.3.5 过去三年的利润分配情况

3.3.6 过去三年的利润分配情况

3.3.7 过去三年的利润分配情况

3.3.8 过去三年的利润分配情况

3.3.9 过去三年的利润分配情况

3.3.10 过去三年的利润分配情况

3.3.11 过去三年的利润分配情况

3.3.12 过去三年的利润分配情况

3.3.13 过去三年的利润分配情况

3.3.14 过去三年的利润分配情况

3.3.15 过去三年的利润分配情况

3.3.16 过去三年的利润分配情况

3.3.17 过去三年的利润分配情况

3.3.18 过去三年的利润分配情况

3.3.19 过去三年的利润分配情况

3.3.20 过去三年的利润分配情况

3.3.21 过去三年的利润分配情况

3.3.22 过去三年的利润分配情况

3.3.23 过去三年的利润分配情况

3.3.24 过去三年的利润分配情况

3.3.25 过去三年的利润分配情况

3.3.26 过去三年的利润分配情况

3.3.27 过去三年的利润分配情况

3.3.28 过去三年的利润分配情况

3.3.29 过去三年的利润分配情况

3.3.30 过去三年的利润分配情况

3.3.31 过去三年的利润分配情况

3.3.32 过去三年的利润分配情况

3.3.33 过去三年的利润分配情况

3.3.34 过去三年的利润分配情况

3.3.35 过去三年的利润分配情况

3.3.36 过去三年的利润分配情况

3.3.37 过去三年的利润分配情况

3.3.38 过去三年的利润分配情况

3.3.39 过去三年的利润分配情况

3.3.40 过去三年的利润分配情况

3.3.41 过去三年的利润分配情况

3.3.42 过去三年的利润分配情况

3.3.43 过去三年的利润分配情况

3.3.44 过去三年的利润分配情况

3.3.45 过去三年的利润分配情况

3.3.46 过去三年的利润分配情况

3.3.47 过去三年的利润分配情况

3.3.48 过去三年的利润分配情况

3.3.49 过去三年的利润分配情况

3.3.50 过去三年的利润分配情况

3.3.51 过去三年的利润分配情况

3.3.52 过去三年的利润分配情况

3.3.53 过去三年的利润分配情况

3.3.54 过去三年的利润分配情况

3.3.55 过去三年的利润分配情况

3.3.56 过去三年的利润分配情况

3.3.57 过去三年的利润分配情况

3.3.58 过去三年的利润分配情况

3.3.59 过去三年的利润分配情况

3.3.60 过去三年的利润分配情况

3.3.61 过去三年的利润分配情况

3.3.62 过去三年的利润分配情况

3.3.63 过去三年的利润分配情况

3.3.64 过去三年的利润分配情况

3.3.65 过去三年的利润分配情况

3.3.66 过去三年的利润分配情况

3.3.67 过去三年的利润分配情况

3.3.68 过去三年的利润分配情况

3.3.69 过去三年的利润分配情况

3.3.70 过去