

## 中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金

## [2014]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:2014年10月27日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会对本基金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、完整性、及时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2014年10月24日复核了本基金中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	大成中证500沪市ETF
场内简称	500沪ETF
交易代码	510440
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年8月24日
报告期末基金份额总额	6,058,261,000份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金为交易型开放式基金，采取完全复制法，按照标的指数的构成比例及其权重，通过一级市场买卖股票，以实现对标的指数的紧密跟踪。

本基金的申购和赎回均以现金方式进行，申购和赎回的款项在T+1日划入基金资产，赎回款项在T+2日划入赎回人账户。

本基金的申购和赎回费用率为0.50%，赎回费率为0.50%。

本基金的申购和赎回费用率为0.50%，赎回费率为0.50%。