

# 大成标普500等权重指数证券投资基金 [2015] 第一季度报告

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:2015年4月18日

§ 1 重要提示  
基金管理人保证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、完整性、及时性承担法律责任。  
基金托管人和中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，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。  
本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	大成标普500等权重指数证券投资基金
交易代码	090600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月22日
报告期末基金份额总额	61,994,724.00份
投资目标	通过精选的资产配置及数量化风险管理手段，实现基金投资者对标的指数的长期回报，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数的变动定期进行相应的调整。但在因特殊原因（如股票停牌、停牌不足、导致无法获得足够数据而无法买卖时，基金经理将根据实际情况选择其他方法进行适当的替代）时，基金经理将根据实际情况选择其他方法进行适当的替代。
业绩比较基准	沪深300指数的货币部分+标的指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相似。
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	
项目	境外资产托管人
名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
注册地址	中国银行(香港)有限公司 香港花园道1号中银大厦
办公地址	-
邮政编码	-
3.3 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( 2015年1月1日 - 2015年3月31日 )
1.本期初次收入	4,966,622.61
2.本期利润	1,767,150.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0263
4.期末基金份额净值	88,824,402.73
5.期末可供分配基金份额利润	1,433
注:1.本期利润为本基金利息收入、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，本期利润即为可供分配的利润，以人民币计价。 2.本期基金净值不包括持有人申购或赎回等费用，以人民币计价。 3.基金净值的计算方法详见《基金合同》第十一部分“基金的申购与赎回”之“（三）申购和赎回的程序”。	
3.2.1 基金合同生效以来基金净值增长率变化率与其同期业绩比较基准收益率变化的比较	
净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准 业绩比较基准标准差	1.80% 0.96% 1.81% 0.96% 0.06% -0.01%
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。 5.2.2 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	14,263,919.14
消费者非必需品	13,982,644.97
信息技术	10,860,470.31
工业	10,795,301.86
医疗保健	9,288,700.09
能源	6,913,438.00
消费品用品	6,374,830.08
公司企业	4,899,781.52
基础材料	4,694,830.06
电信服务	964,046.75
合计	62,967,888.93
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.5 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.6 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.7 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.8 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.9 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.10 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.11 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.12 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.13 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.14 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.15 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.16 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.17 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.18 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.19 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.20 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47
基础材料	5.27
电信服务	1.07
合计	92.41
注:以上分部采用全球行业分类标准(GICS)。	
5.2.21 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合	
行业类别	占基金资产净值比例(%)
金融	16.06
消费者非必需品	15.74
信息技术	12.23
工业	12.15
医疗保健	10.46
能源	7.78
消费品用品	7.18
公司企业	5.47