

大成沪深300指数证券投资基金

[2015] 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:中国农业银行股份有限公司

报告期起止日期:2015年4月1日至2015年6月30日

§ 1 基金产品概况

基金简称 大成沪深300指数
基金代码 519300
前庭交易代码 519300
后场交易代码 519301
基金运作方式 灵活配置型开放式
基金合同生效日 2006年4月6日
报告期末基金份额总额 2,324,405,676.12份

投资目标 通过标的指数的成份股和数量化风险管理手段,实现对指数的适度跟踪误差,在正常市况下本基金力争跟踪误差不超过标的指数的0.5%。

投资策略 本基金主要采用主动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要根据指数成份股的构成及其权重、剩余可利用资金比例、申购限制、预期的指数变动等情况进行相应调整。

业绩比较基准 沪深300指数

风险收益特征 本基金为指数基金,风险中等,获得证券市场平均收益率的产品。

基金管理人 大成基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

		报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	
1.本期已实现收益	1,590,603,177.35	2.期初现金及银行存款余额	730,239,758.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1037	4.期末现金及银行存款余额	3,268,069,234.10
5.期末基金份额净值	1.4460		
注:1.本报告期内本基金实现的期间利润已扣除收入税费、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和扣除相关费用后的余额,本期利润即为当期实现的收入加上期末公允价值变动收益。 2.本基金基金合同不包括任何交易成本的费用,计算时使用的是投资水平低于所列示的数字。			

3.2.1 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率差额的比较

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 2.48% 10.41% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.2 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.3 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.4 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.5 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.6 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.7 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.8 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.9 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.10 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.11 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.12 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.13 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.14 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.15 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.16 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.17 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.18 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.19 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.20 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.21 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.22 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.23 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.24 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.25 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.26 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.27 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.28 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.29 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.30 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.31 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.32 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.33 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.34 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11.39% 2.48% 2.61% 0.98% -0.13%

3.2.35 自基金成立以来(某只基金累计净值增值得率与其同期业绩比较基准收益率差额的比较)

新发 净值增长率为 1.33% 净值增长率差额为 1.13% ①-③ ②-④

过去三个月 11