

大成标普500等权重指数证券投资基金

[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:中国银行股份有限公司
报告期截至日:2015年6月30日

基金管理人的董事会及董事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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

5.1 重要提示

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。

本报告期财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称: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

报告期末基金资产总额:426,659.9376元

投资目标:通过广泛的资产配置和量化化的风险管理手段,实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金将坚持被动型的指数化投资策略,通过资产配置的组合管理策略,交易策略及风险控制方法,以期更好的跟踪指数,力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 报告期内本基金持有他人或基金资产净值变动情况

5.2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 57,017,532.26 90.22

2 固定收益投资 57,017,532.26 90.22

3 优先股 - 0.00

4 衍生工具 - 0.00

5 非现金类投资 - 0.00

6 货币市场工具 - 0.00

7 其他 - 0.00

8 买入返售金融资产 - 0.00

9 其中:买断式回购的买入返售金融资产 - 0.00

10 银行存款和结算备付金 - 0.00

11 其他资产 - 0.00

12 其他负债 - 0.00

13 其中:应付利息 - 0.00

14 其他应付款 - 0.00

15 其他 - 0.00

16 其他 - 0.00

17 衍生工具和嵌套衍生产品 - 0.00

18 其他 - 0.00

19 其他 - 0.00

20 其他 - 0.00

21 其他 - 0.00

22 其他 - 0.00

23 其他 - 0.00

24 其他 - 0.00

25 其他 - 0.00

26 其他 - 0.00

27 其他 - 0.00

28 其他 - 0.00

29 其他 - 0.00

30 其他 - 0.00

31 其他 - 0.00

32 其他 - 0.00

33 其他 - 0.00

34 其他 - 0.00

35 其他 - 0.00

36 其他 - 0.00

37 其他 - 0.00

38 其他 - 0.00

39 其他 - 0.00

40 其他 - 0.00

41 其他 - 0.00

42 其他 - 0.00

43 其他 - 0.00

44 其他 - 0.00

45 其他 - 0.00

46 其他 - 0.00

47 其他 - 0.00

48 其他 - 0.00

49 其他 - 0.00

50 其他 - 0.00

51 其他 - 0.00

52 其他 - 0.00

53 其他 - 0.00

54 其他 - 0.00

55 其他 - 0.00

56 其他 - 0.00

57 其他 - 0.00

58 其他 - 0.00

59 其他 - 0.00

60 其他 - 0.00

61 其他 - 0.00

62 其他 - 0.00

63 其他 - 0.00

64 其他 - 0.00

65 其他 - 0.00

66 其他 - 0.00

67 其他 - 0.00

68 其他 - 0.00

69 其他 - 0.00

70 其他 - 0.00

71 其他 - 0.00

72 其他 - 0.00

73 其他 - 0.00

74 其他 - 0.00

75 其他 - 0.00

76 其他 - 0.00

77 其他 - 0.00

78 其他 - 0.00

79 其他 - 0.00

80 其他 - 0.00

81 其他 - 0.00

82 其他 - 0.00

83 其他 - 0.00

84 其他 - 0.00

85 其他 - 0.00

86 其他 - 0.00

87 其他 - 0.00

88 其他 - 0.00

89 其他 - 0.00

90 其他 - 0.00

91 其他 - 0.00

92 其他 - 0.00

93 其他 - 0.00

94 其他 - 0.00

95 其他 - 0.00

96 其他 - 0.00

97 其他 - 0.00

98 其他 - 0.00

99 其他 - 0.00

100 其他 - 0.00

101 其他 - 0.00

102 其他 - 0.00

103 其他 - 0.00

104 其他 - 0.00

105 其他 - 0.00

106 其他 - 0.00

107 其他 - 0.00

108 其他 - 0.00

109 其他 - 0.00

110 其他 - 0.00

111 其他 - 0.00

112 其他 - 0.00

113 其他 - 0.00

114 其他 - 0.00

115 其他 - 0.00

116 其他 - 0.00

117 其他 - 0.00

118 其他 - 0.00

119 其他 - 0.00

120 其他 - 0.00

121 其他 - 0.00

122 其他 - 0.00

123 其他 - 0.00

124 其他 - 0.00

125 其他 - 0.00

126 其他 - 0.00

127 其他 - 0.00

128 其他 - 0.00

129 其他 - 0.00

130 其他 - 0.00

131 其他 - 0.00

132 其他 - 0.00

133 其他 - 0.00

134 其他 - 0.00

135 其他 - 0.00

136 其他 - 0.00

137 其他 - 0.00

138 其他 - 0.00

139 其他 - 0.00

140 其他 - 0.00

141 其他 - 0.00

142 其他 - 0.00

143 其他 - 0.00

144 其他 - 0.00

145 其他 - 0.00

146 其他 - 0.00

147 其他 - 0.00

148 其他 - 0.00

149 其他 - 0.00

150 其他 - 0.00

151 其他 - 0.00

152 其他 - 0.00

153 其他 - 0.00

154 其他 - 0.00

155 其他 - 0.00

156 其他 - 0.00

157 其他 - 0.00

158 其他 - 0.00

159 其他 - 0.00

160 其他 - 0.00

161 其他 - 0.00

162 其他 - 0.00

163 其他 - 0.00

164 其他 - 0.00

165 其他 - 0.00

166 其他 - 0.00