

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2011 年半年度报告
2011 年 6 月 30 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

送出日期：2011 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）根据本基金合同规定，于 2011 年 8 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。

基金的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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 2011 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§ 6 半年度财务报表(未经审计)	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§ 7 投资组合报告	27
7.1 期末基金资产组合情况.....	27
7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布.....	27
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	28
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	28
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	53
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	55
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	55
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	55
7.11 投资组合报告附注.....	55

§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 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
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
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
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	170,944,774.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资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有效跟踪，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，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普 500 等权重指数（全收益指数）
风险收益特征	本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

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
信息披露负责人	姓名	杜鹏	唐州徽
	联系电话	0755-83183388	010-66594855
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	张树忠	肖钢

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	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

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 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及投资者服务部

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,357,978.50
本期利润	-1,262,670.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0032
本期加权平均净值利润率	-0.32%
本期基金份额净值增长率	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-2,373,889.80
期末可供分配基金份额利润	-0.0139

期末基金资产净值	168,570,884.63
期末基金份额净值	0.986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.40%

注：1、本期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加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

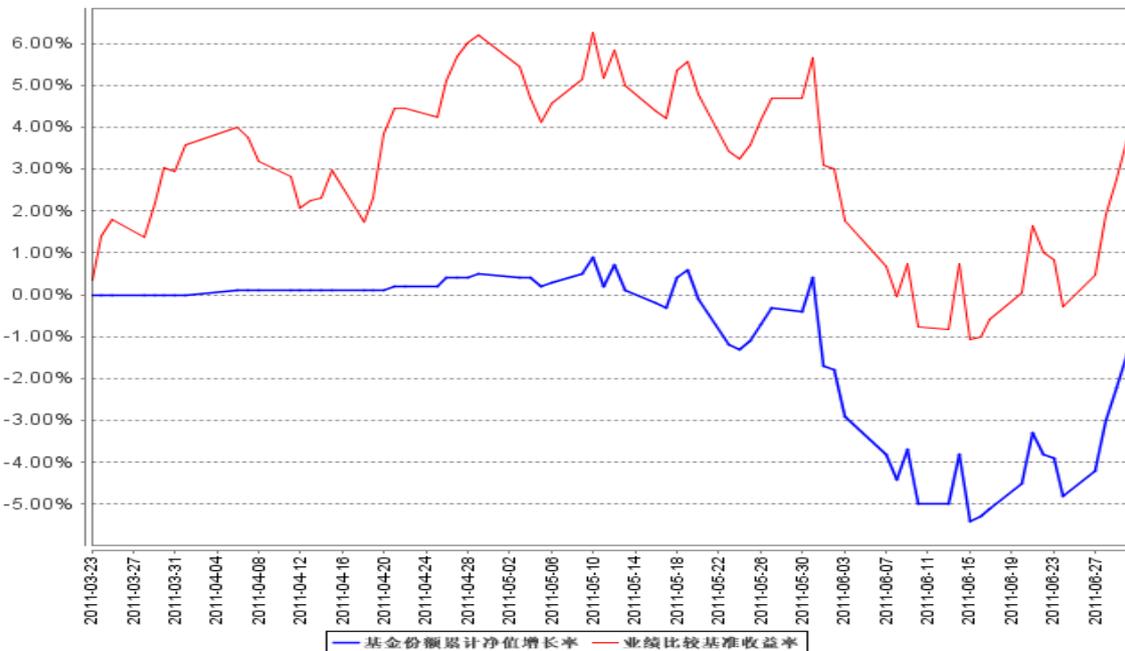
3.2 净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.79%	1.00%	-1.82%	1.13%	0.03%	-0.13%
过去三个月	-1.40%	0.65%	0.77%	0.85%	-2.17%	-0.20%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.62%	3.72%	0.83%	-5.12%	-0.21%

注：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素产生的效应。

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



注：1、本基金合同于 2011 年 3 月 23 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、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素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托投资有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金，1 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF 及大成深证成长 40ETF 联接基金，1 只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数基金及 17 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金和大成内需增长股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张英辉先生	本基金基金经理	2011 年 3 月 23 日	-	19 年	英国艾克斯特大学金融及投资学硕士。曾任职于高诚资产管理(香港)有限公司、殷诚资产管理(亚洲)有限公司、中国太平洋保险集团资金运用中心、景顺长城基金管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司、国海富兰克林基金管理有限公司、广发资产管理(香港)有限公司、海通资产管理(香港)有限公司。2004 年 9 月 15 日至 2005 年 10 月 11 日曾任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理；2005 年 4 月 13 日至 2005 年 10 月 11 日曾任上投摩根货币市场基金基金经理；2006 年 3 月 6 日至 2007 年 3 月 20 日曾任富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。2010 年 3 月加入大成基金管理有限公司国际业务部，2011 年 3 月 23 日起任大成标普 500 等权重证券投资基金基金

					经理，具有基金从业资格。国籍：中国香港。
--	--	--	--	--	----------------------

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成标普 500 等权重指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《公平交易制度》和《异常交易监控与报告制度》，公平对待旗下各投资组合，所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5 日内、10 日内）同向、反向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据各基金合同，目前本基金管理人旗下未有与本基金投资风格相似的其他基金。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自 2011 年 3 月 23 日基金合同生效。1 季度末，国际政治经济形势发生了巨大的不利变化。

中东及北非方面，该地区若干产油大国发生激烈的政治动荡，石油产出受到影响，并快速推高原油价格；亚洲方面，日本地震造成了产业链的中断，使得众多行业产能短期受损；欧洲方面，欧债危机阴霾不散，欧洲金融市场持续动荡；美国受制于国债上限的规定及控制财政赤字的需要，政府减少财政支出。

上述各种不利因素使得正在复苏过程中的美国经济受到了较大影响。经过美国商务部最新修正后，美国 2011 年 1 季度 GDP 年化增长率仅为 0.4%，2011 年 2 季度 GDP 年化增长率也仅为 1.3%，远远低于市场的一致预期。数据表明 2008-2009 年的经济衰退程度更深，经济活动尚未恢复至衰退前峰值。

除了个人支出增速减缓的因素之外，政府财政支出的削减亦是造成今年以来经济活动疲弱的重要因素。据估算，今年 1 季度联邦、州和地方政府的开支削减令实际 GDP 折年增速下降了 1

个多百分点；财政政策对今年 2 季度的影响虽然有所减少，但仍为负面影响。

经济增速的降低导致美国股票市场由上涨转为震荡，本基金的基准指数在基金合同生效以来出现较大波动，期间收益率为 3.72%。同期，美元兑人民币汇率持续下跌，相同期间内共下跌 1.34%。

在本报告期间，本基金处于建仓期。根据基金合同，本基金严格依据指数化投资方法逐步增加股票仓位，至报告期末，本基金的股票仓位已经达到了基金合同的要求。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 0.986 元，本报告期（自基金合同生效至今）基金份额净值增长率为-1.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%，低于业绩比较基准的表现。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，基金管理人对于 2011 年下半年的美国市场保持相对中性的态度。

造成基金管理人下调对美国宏观经济增长率预期的主要原因是，政府降低财政支出水平及消费者信心的下降已经影响到实体经济。7 月消费信心指标的急剧下滑印证了消费者已经受到失业率居高不下及持久债务上限谈判的影响，而 7 月份制造业 ISM 指数更是急速下降到 50.7%，创出了金融海啸后的最低水平。众多经济指标已经反映出美国宏观经济增长正在继续放缓，虽然我们预计美国经济不会出现衰退，但这种可能性也不能完全排除。

但是在出现种种不利因素的同时，也仍然有积极因素。从国际方面来看，北非危机及日本地震对美国宏观经济带来的负面影响会逐步减弱，欧债危机也有望得到逐步解决。从美国方面来看，美国国债上限问题已经得到解决，消费者信心指标也有望在不久后有所恢复。另外，如果美国经济持续恶化，美联储推出新的经济刺激计划的可能性也会增大。

综合上述各种因素，基金管理人预计下半年美国经济出现衰退的概率较小，但出现经济强劲增长的可能性也不大。

如果下半年美国经济出现温和增长，企业盈利也会随之小幅增加。当前标普 500 指数的历史市盈率为 13.8 倍左右，2011 年的预期市盈率更是在 13 倍以下，显著低于历史平均水平。因此，在美国经济不出现衰退的情况下，企业盈利的温和增长有望推动标的指数小幅增长。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是复制指数的收益率。本基金将坚持被动型的指数化投资理念，继续深入研究更为高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好地跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益部、金融工程部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会 8 名成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、固定收益部、金融工程部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信

息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报表（注：财务会计报表中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,203,512.37
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	155,381,918.89
其中：股票投资		155,381,918.89
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-

应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,103.91
应收股利		190,587.84
应收申购款		55,024.14
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		171,833,147.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		2,973,285.61
应付管理人报酬		139,158.86
应付托管费		34,789.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	115,028.36
负债合计		3,262,262.52
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	170,944,774.43
未分配利润	6.4.7.10	-2,373,889.80
所有者权益合计		168,570,884.63
负债和所有者权益总计		171,833,147.15

注：1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.986 元，基金份额总额 170,944,774.43 份。

2、股票投资是指普通股的投资。

6.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年3月23日(基金合同 生效日)至2011年6月30日
一、收入		279,213.74
1. 利息收入		2,337,310.01

其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,337,310.01
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-27,764.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-457,355.64
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	429,590.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,620,648.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-228,945.63
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	819,263.14
减：二、费用		1,541,884.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,090,291.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	272,572.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	63,240.02
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	115,779.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,262,670.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,262,670.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日) 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	822,754,222.26	-	822,754,222.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,262,670.37	-1,262,670.37
三、本期基金份额交易	-651,809,447.83	-1,111,219.43	-652,920,667.26

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	2,517,817.46	-28,851.04	2,488,966.42
2. 基金赎回款	-654,327,265.29	-1,082,368.39	-655,409,633.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	170,944,774.43	-2,373,889.80	168,570,884.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>王颢</u>	<u>刘彩晖</u>	<u>范瑛</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成标普 500 等权重指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2010】1876 号文《关于核准大成标普 500 等权重指数证券投资基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 822,469,878.87 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 091 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 822,754,222.26 份,其中认购资金利息折合 284,343.39 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%—95%,其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%—20%,其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为标普 500 等权重指数(全收益指数)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间系自 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日止会计期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并

进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金

红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的限期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目上。以公允价值计量的外币非货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的 A 股股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出 A 股股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入 A 股股票不征收股票交易印花税。

(5) 基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税，按照相关国家或地区税收相关法律和法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	16,203,512.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	16,203,512.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	158,002,567.76	155,381,918.89	-2,620,648.87
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	158,002,567.76	155,381,918.89	-2,620,648.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产
6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	2,103.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,103.91

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,205.69
预提费用	60,211.00
指数使用费	43,611.67
合计	115,028.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	822,754,222.26	822,754,222.26

本期申购	2,517,817.46	2,517,817.46
本期赎回(以“-”号填列)	-654,327,265.29	-654,327,265.29
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	170,944,774.43	170,944,774.43

注：1、本基金自 2011 年 2 月 21 日至 2011 年 3 月 18 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 822,469,878.87 元，折合 822,469,878.87 份基金份额。根据《大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 284,343.39 元，折算为 284,343.39 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 4 月 24 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2011 年 4 月 25 日起开始办理。

3、本期申购包含基金转入的份额和金额；本期赎回包含基金转出的份额和金额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,357,978.50	-2,620,648.87	-1,262,670.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,312,070.24	200,850.81	-1,111,219.43
其中：基金申购款	6,992.17	-35,843.21	-28,851.04
基金赎回款	-1,319,062.41	236,694.02	-1,082,368.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,908.26	-2,419,798.06	-2,373,889.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	287,435.01
定期存款利息收入	2,049,875.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,337,310.01

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,576,476.49
减: 卖出股票成本总额	15,033,832.13
买卖股票差价收入	-457,355.64

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 其他衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	429,590.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	429,590.73

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,620,648.87
——股票投资	-2,620,648.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,620,648.87

6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
----	---

基金赎回费收入	819,263.14
合计	819,263.14

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	63,240.02
银行间市场交易费用	-
合计	63,240.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	33,803.00
信息披露费	26,408.00
银行汇划费	11,056.93
开户费	900.00
指数使用费	43,611.67
合计	115,779.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
中泰信托投资有限责任公司	基金管理人的股东

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,090,291.61
其中：支付销售机构的客户维护费	424,359.90

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	272,572.88

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	13,986,083.35	2,337,310.01
中银香港	2,217,429.02	0.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况
6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券
6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理
6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、金融工程部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。；在管理层层面设立投资风险

控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。金融工程部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行及境外次托管行中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额中，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,203,512.37	-	-	-	16,203,512.37
交易性金融资产	-	-	-	155,381,918.89	155,381,918.89
应收股利	-	-	-	190,587.84	190,587.84
应收利息	-	-	-	2,103.91	2,103.91
应收申购款	55,024.14	-	-	-	55,024.14
资产总计	16,258,536.51	-	-	155,574,610.64	171,833,147.15
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	139,158.86	139,158.86
应付赎回款	-	-	-	2,973,285.61	2,973,285.61
应付托管费	-	-	-	34,789.69	34,789.69
其他负债	-	-	-	115,028.36	115,028.36
负债总计	-	-	-	3,262,262.52	3,262,262.52
利率敏感度缺口	16,258,536.51	-	-	-152,312,348.12	168,570,884.63

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	2,218,518.90	-	-	2,218,518.90
交易性金融资产	155,381,918.89	-	-	155,381,918.89
应收股利	190,587.84	-	-	190,587.84
资产合计	157,791,025.63	-	-	157,791,025.63
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	157,791,025.63	-	-	157,791,025.63

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2011年6月30日）
	美元相对人民币升值 5%	增加约 800
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 800

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人通过严格的投资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有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票和目标基金投资比例不低于基金资产的 80%，目标基金的比例不超过 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	155,381,918.89	92.18
交易性金融资产—基金投资	-	0.00
交易性金融资产—债券投资	-	0.00
衍生金融资产—权证投资	-	0.00
其他	-	0.00

合计	155,381,918.89	92.18
----	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2011年6月30日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 514
	业绩比较基准下降 5%	减少约 526

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	155,381,918.89	90.43
	其中：普通股票	155,381,918.89	90.43
	存托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	16,203,512.37	9.43
8	其他各项资产	247,715.89	0.14
9	合计	171,833,147.15	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	155,381,918.89	92.18
合计	155,381,918.89	92.18

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	25,276,026.98	14.99
消费者非必需品	24,884,410.97	14.76
信息技术	23,092,537.61	13.70
工业	18,831,722.89	11.17
医疗保健	15,949,691.47	9.46
能源	12,910,069.34	7.66
消费者常用品	12,423,296.06	7.37
公用事业	10,038,935.14	5.96
基础材料	9,518,424.55	5.65
电信服务	2,456,803.88	1.46
合计	155,381,918.89	92.18

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	美国	847	347,797.70	0.21
2	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOYG UQ	纳斯达克交易所	美国	556	342,693.48	0.20
3	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	1,976	342,075.83	0.20
4	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	1,598	341,997.27	0.20
5	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	美国	1,267	341,591.89	0.20
6	Biogen Idec Inc	生物基因	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	491	339,744.24	0.20
7	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UN	纽约交易所	美国	3,117	338,284.06	0.20
8	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克	美国	1,615	337,274.23	0.20

				交易所				
9	National Oilwell Varco Inc	美国国民石油	NOV UN	纽约交易所	美国	666	337,091.79	0.20
10	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG UN	纽约交易所	美国	169	337,067.53	0.20
11	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	489	336,904.64	0.20
12	Cliffs Natural Resources Inc	克里夫斯自然资源股份有限公司	CLF UN	纽约交易所	美国	561	335,645.97	0.20
13	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	美国	172	335,426.13	0.20
14	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	614	334,812.37	0.20
15	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	美国	469	334,628.64	0.20
16	Tellabs Inc	Tellabs 公司	TLAB UQ	纳斯达克交易所	美国	11,212	334,499.66	0.20
17	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,308	334,277.04	0.20
18	CBS Corp B	维亚康姆	CBS UN	纽约交易所	美国	1,813	334,273.48	0.20
19	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne 公司	HP UN	纽约交易所	美国	780	333,763.71	0.20
20	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	美国	1,123	333,583.15	0.20
21	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	1,726	333,088.85	0.20
22	Titanium Metals Corp	钛金属公司	TIE UN	纽约交易所	美国	2,803	332,322.87	0.20
23	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	美国	902	331,855.23	0.20
24	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克交易所	美国	2,075	331,282.82	0.20
25	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	494	330,854.47	0.20
26	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	美国	250	330,844.37	0.20
27	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	美国	386	330,415.43	0.20
28	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	美国	1,163	330,186.27	0.20

29	Supervalu Inc	Supervalu 公司	SVU UN	纽约交易所	美国	5,416	329,822.25	0.20
30	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	美国	997	329,642.14	0.20
31	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	美国	1,415	329,571.73	0.20
32	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇	SIAL UQ	纳斯达克交易所	美国	694	329,570.89	0.20
33	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	美国	1,242	329,305.68	0.20
34	Eaton Corp	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	989	329,301.22	0.20
35	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	美国	662	328,855.13	0.20
36	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克墨伦	FCX UN	纽约交易所	美国	960	328,653.73	0.19
37	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约交易所	美国	1,103	328,641.57	0.19
38	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond 公司	BBBY UQ	纳斯达克交易所	美国	869	328,262.40	0.19
39	Priceline.com Inc	Priceline.com 股份有限公司	PCLN UQ	纳斯达克交易所	美国	99	327,987.61	0.19
40	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	2,863	327,948.98	0.19
41	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	美国	353	327,913.51	0.19
42	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	美国	1,131	327,835.01	0.19
43	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	美国	810	327,519.91	0.19
44	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	美国	690	327,492.73	0.19
45	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	美国	562	327,260.79	0.19
46	AK Steel Hldg Corp	AK Steel Holding Corp	AKS UN	纽约交易所	美国	3,208	327,191.67	0.19
47	Peabody Energy Corp	博地能源公司	BTU UN	纽约交易所	美国	858	327,105.60	0.19

48	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	美国	991	327,081.14	0.19
49	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,385	326,886.66	0.19
50	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	美国	1,378	326,483.03	0.19
51	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	581	326,217.57	0.19
52	Jabil Circuit Inc	捷普科技	JBL UN	纽约交易所	美国	2,495	326,162.17	0.19
53	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	美国	760	326,140.16	0.19
54	Novellus Systems Inc	诺发系统	NVLS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,394	326,033.77	0.19
55	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	531	325,944.40	0.19
56	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	美国	4,026	325,683.27	0.19
57	DuPont, E. I. de Nemours	杜邦	DD UN	纽约交易所	美国	931	325,654.47	0.19
58	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	美国	1,907	325,441.17	0.19
59	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	美国	693	325,328.76	0.19
60	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	美国	835	325,307.92	0.19
61	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	美国	1,493	325,129.62	0.19
62	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	美国	135	325,099.86	0.19
63	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	美国	998	324,805.85	0.19
64	DIRECTV Class A	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	美国	987	324,611.18	0.19
65	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	美国	788	324,284.89	0.19
66	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	美国	2,186	324,105.88	0.19
67	Limited Brands Inc	Ltd Brands 公司	LTD UN	纽约交易所	美国	1,302	323,980.59	0.19

68	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	美国	738	323,815.57	0.19
69	Macys Inc	联合百货	M UN	纽约交易所	美国	1,710	323,582.59	0.19
70	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	美国	977	323,155.92	0.19
71	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	美国	580	322,878.48	0.19
72	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约交易所	美国	786	322,851.43	0.19
73	Polo Ralph Lauren A	Polo Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	美国	376	322,682.78	0.19
74	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	美国	474	322,674.36	0.19
75	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	2,182	322,524.35	0.19
76	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,075	322,455.56	0.19
77	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,916	322,389.23	0.19
78	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIA/B UN	纽约交易所	美国	976	322,130.36	0.19
79	Salesforce.com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	334	322,022.42	0.19
80	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	美国	1,060	322,003.52	0.19
81	Carnival Corp	嘉年华	CCL UN	纽约交易所	美国	1,322	321,941.78	0.19
82	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	美国	302	321,795.78	0.19
83	Monster Worldwide Inc	Monster Worldwide 公司	MWW UN	纽约交易所	美国	3,391	321,716.57	0.19
84	Expeditors Intl of WA Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD UQ	纳斯达克交易所	美国	971	321,674.05	0.19
85	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,961	321,585.06	0.19
86	ProLogis, Inc	普洛斯	PLD UN	纽约交易所	美国	1,386	321,471.81	0.19
87	ONEOK Inc	Oneok 股份有	OKE UN	纽约交易	美国	671	321,384.25	0.19

		限公司		所				
88	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	美国	2,271	321,276.50	0.19
89	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	美国	632	321,150.82	0.19
90	Intl Game Technology	国际游戏技术	IGT UN	纽约交易所	美国	2,822	321,060.99	0.19
91	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	美国	610	321,025.01	0.19
92	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price Group 公司	TROW UQ	纳斯达克交易所	美国	822	320,987.99	0.19
93	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	美国	1,191	320,947.61	0.19
94	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	美国	546	320,805.88	0.19
95	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	美国	2,099	320,715.61	0.19
96	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	美国	6,467	320,585.07	0.19
97	MetroPCS Communications Inc	MetroPCS 通信有限公司	PCS UN	纽约交易所	美国	2,877	320,429.43	0.19
98	Stanley Black & Decker	史丹利Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	美国	687	320,333.52	0.19
99	Watson Pharmaceuticals	华生制药	WPI UN	纽约交易所	美国	720	320,251.01	0.19
100	MeadWestvaco Corp	MeadWestvaco Corp	MWV UN	纽约交易所	美国	1,485	320,119.96	0.19
101	QEP Resources	QEP Resources Inc	QEP UN	纽约交易所	美国	1,182	319,975.71	0.19
102	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	美国	455	319,663.39	0.19
103	Bemis Co Inc	Bemis 公司	BMS UN	纽约交易所	美国	1,462	319,608.77	0.19
104	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	美国	2,543	319,600.35	0.19
105	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	美国	1,733	319,523.41	0.19
106	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	美国	2,443	319,364.40	0.19
107	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	美国	1,702	319,315.09	0.19

108	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	美国	2,053	319,001.54	0.19
109	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	美国	3,106	318,798.52	0.19
110	Alpha Natural Resources	阿尔法自然资源股份有限公司	ANR UN	纽约交易所	美国	1,084	318,771.34	0.19
111	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	4,730	318,657.05	0.19
112	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	美国	710	318,651.88	0.19
113	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	美国	867	318,641.72	0.19
114	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	美国	905	318,609.81	0.19
115	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	美国	875	318,524.06	0.19
116	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	454	318,461.35	0.19
117	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	美国	751	318,389.84	0.19
118	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	美国	482	318,388.09	0.19
119	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约交易所	美国	2,639	318,344.22	0.19
120	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	美国	2,001	318,302.93	0.19
121	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	美国	1,021	318,217.37	0.19
122	JDS Uniphase Corp	捷迪讯	JDSU UQ	纳斯达克交易所	美国	2,951	318,167.54	0.19
123	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	美国	769	318,157.90	0.19
124	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	702	318,105.29	0.19
125	Rowan Companies Inc	Rowan 公司	RDC UN	纽约交易所	美国	1,266	317,972.10	0.19
126	Williams Cos Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	美国	1,624	317,923.82	0.19
127	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	548	317,867.13	0.19
128	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	美国	1,559	317,810.57	0.19

129	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,492	317,766.69	0.19
130	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	909	317,606.13	0.19
131	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	美国	949	317,518.05	0.19
132	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	721	317,382.93	0.19
133	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	美国	612	317,324.81	0.19
134	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	美国	2,293	317,265.92	0.19
135	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	美国	628	317,167.42	0.19
136	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克 OMX 集团股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	美国	1,937	317,147.88	0.19
137	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	美国	654	317,135.71	0.19
138	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UN	纽约交易所	美国	1,252	317,129.63	0.19
139	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UN	纽约交易所	美国	3,311	317,126.52	0.19
140	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	美国	1,782	317,025.43	0.19
141	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	美国	2,890	317,014.56	0.19
142	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	美国	1,610	316,954.38	0.19
143	Sunoco Inc	太阳石油	SUN UN	纽约交易所	美国	1,174	316,898.33	0.19
144	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	美国	882	316,791.29	0.19
145	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	美国	990	316,692.28	0.19
146	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	美国	3,548	316,635.46	0.19
147	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	美国	2,633	316,598.05	0.19
148	Newell Rubbermaid	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	美国	3,100	316,577.73	0.19

	Inc							
149	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	美国	1,267	316,501.36	0.19
150	Grainger, W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	美国	318	316,206.91	0.19
151	SLM Corp	SLM 公司	SLM UN	纽约交易所	美国	2,906	316,136.75	0.19
152	BMC Software Inc	BMC 软件	BMC UQ	纳斯达克交易所	美国	893	316,118.89	0.19
153	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	美国	372	316,072.17	0.19
154	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UN	纽约交易所	美国	1,376	316,035.67	0.19
155	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UN	纽约交易所	美国	1,342	315,956.20	0.19
156	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	美国	981	315,908.31	0.19
157	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	美国	868	315,863.52	0.19
158	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	美国	924	315,611.65	0.19
159	Coventry Health Care Inc	Coventry Health Care Inc	CVH UN	纽约交易所	美国	1,337	315,557.74	0.19
160	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	美国	4,269	315,503.31	0.19
161	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	美国	1,430	315,482.09	0.19
162	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	美国	757	315,446.69	0.19
163	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业	PCL UN	纽约交易所	美国	1,202	315,355.11	0.19
164	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	美国	557	315,229.37	0.19
165	Chicago Mercantile Exchange	芝加哥商业交易所控股公司	CME UQ	纳斯达克交易所	美国	167	315,137.99	0.19
166	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	美国	927	315,136.57	0.19
167	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	美国	2,469	315,093.66	0.19

168	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	1,547	315,063.96	0.19
169	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	美国	695	315,023.25	0.19
170	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	美国	1,447	315,018.59	0.19
171	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	美国	1,283	314,769.11	0.19
172	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	美国	1,765	314,686.40	0.19
173	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	美国	816	314,684.40	0.19
174	LSI Corporation	LSI 公司	LSI UN	纽约交易所	美国	6,822	314,342.70	0.19
175	El Paso Corp	埃尔帕索能源	EP UN	纽约交易所	美国	2,404	314,266.07	0.19
176	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	美国	508	314,226.21	0.19
177	Verizon Communications Inc	Verizon 通信	VZ UN	纽约交易所	美国	1,304	314,182.72	0.19
178	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	美国	465	314,170.29	0.19
179	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公司	DNR UN	纽约交易所	美国	2,427	314,131.46	0.19
180	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	美国	1,001	314,056.91	0.19
181	ITT Corporation	ITT 工业	ITT UN	纽约交易所	美国	823	313,868.65	0.19
182	United Parcel Service Inc B	UPS 公司	UPS UN	纽约交易所	美国	665	313,862.57	0.19
183	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	美国	393	313,822.57	0.19
184	Gannett Co Inc	甘乃特	GCI UN	纽约交易所	美国	3,386	313,791.83	0.19
185	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	美国	582	313,747.05	0.19
186	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	美国	606	313,743.17	0.19
187	Starwood	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易	美国	865	313,708.22	0.19

	Hotel & Resort World			所				
188	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	美国	938	313,655.54	0.19
189	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	美国	738	313,594.84	0.19
190	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,197	313,578.53	0.19
191	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	美国	1,632	313,575.42	0.19
192	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	美国	1,673	313,549.54	0.19
193	US Bancorp	US Bancorp 公司	USB UN	纽约交易所	美国	1,899	313,506.89	0.19
194	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	美国	1,272	313,469.81	0.19
195	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	美国	934	313,466.44	0.19
196	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	美国	2,667	313,264.59	0.19
197	Electronic Arts	电子艺界	ERTS UQ	纳斯达克交易所	美国	2,050	313,096.01	0.19
198	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	美国	282	313,077.24	0.19
199	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan Cos Inc	MMC UN	纽约交易所	美国	1,551	313,068.12	0.19
200	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	美国	540	313,017.05	0.19
201	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	美国	748	313,003.33	0.19
202	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	美国	1,065	312,977.25	0.19
203	NetFlix Inc	NetFlix Inc	NFLX UQ	纳斯达克交易所	美国	184	312,804.53	0.19
204	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	美国	1,251	312,747.38	0.19
205	Goodrich Corp	古德里奇	GR UN	纽约交易所	美国	506	312,727.13	0.19
206	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	美国	752	312,633.16	0.19
207	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	美国	1,328	312,574.14	0.19

208	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	美国	559	312,562.75	0.19
209	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	美国	1,981	312,557.44	0.19
210	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	790	312,428.79	0.19
211	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	美国	642	312,396.95	0.19
212	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	美国	1,059	312,310.55	0.19
213	DeVry Inc	迪弗莱公司	DV UN	纽约交易所	美国	816	312,255.22	0.19
214	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	美国	1,332	312,222.60	0.19
215	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	美国	545	312,176.72	0.19
216	CB Richard Ellis Group Inc A	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	美国	1,921	312,166.10	0.19
217	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	美国	2,382	312,160.86	0.19
218	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	美国	1,839	312,051.36	0.19
219	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UN	纽约交易所	美国	1,468	311,895.14	0.19
220	CIGNA Corp	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	美国	937	311,865.82	0.19
221	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	美国	1,114	311,804.92	0.18
222	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	美国	1,459	311,776.97	0.18
223	Schwab, Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	美国	2,928	311,708.50	0.18
224	IntercontinentalExchange	洲际交易所公司	ICE UN	纽约交易所	美国	386	311,530.27	0.18
225	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	美国	3,778	311,489.24	0.18
226	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	美国	1,255	311,473.25	0.18

227	Legg Mason Inc	Legg Mason Inc	LM UN	纽约交易所	美国	1,469	311,442.13	0.18
228	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	美国	1,715	311,432.16	0.18
229	Abercrombie & Fitch Company A	阿贝克隆比 & 费奇公司	ANF UN	纽约交易所	美国	719	311,384.14	0.18
230	Hospira, Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	美国	849	311,312.05	0.18
231	Lexmark International Inc	利盟国际	LXK UN	纽约交易所	美国	1,644	311,306.22	0.18
232	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交易所	美国	1,863	311,180.61	0.18
233	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	美国	643	311,094.21	0.18
234	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	美国	1,142	311,068.97	0.18
235	Waters Corp	活德	WAT UN	纽约交易所	美国	502	311,034.67	0.18
236	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	美国	1,335	311,025.10	0.18
237	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	美国	1,639	310,995.84	0.18
238	Cardinal Health Inc	Cardinal Health Inc	CAH UN	纽约交易所	美国	1,058	310,988.60	0.18
239	Gilead Sciences Inc	Gilead 科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	1,160	310,867.19	0.18
240	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	美国	1,065	310,771.73	0.18
241	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	美国	1,784	310,684.95	0.18
242	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	美国	914	310,658.03	0.18
243	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	美国	917	310,550.15	0.18
244	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	美国	889	310,503.03	0.18
245	Assurant Inc	Assurant Inc	AIZ UN	纽约交易所	美国	1,322	310,306.36	0.18
246	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	美国	2,989	310,271.54	0.18
247	Peoples United	Peoples United	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	3,567	310,251.61	0.18

	Financial Inc	Financial 股份有限公司						
248	Marshall & Ilesley Corp (WI)	Marshall & Ilesley Corp	MI UN	纽约交易所	美国	6,010	309,987.70	0.18
249	Celgene Corp	Celgene 公司	CELG UQ	纳斯达克交易所	美国	794	309,951.33	0.18
250	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	美国	709	309,944.02	0.18
251	Dell Inc	戴尔	DELL UQ	纳斯达克交易所	美国	2,873	309,943.76	0.18
252	Allergan Inc	爱力根	AGN UN	纽约交易所	美国	575	309,787.40	0.18
253	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	美国	1,872	309,776.34	0.18
254	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	美国	1,315	309,769.61	0.18
255	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	美国	3,677	309,586.91	0.18
256	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	美国	533	309,545.82	0.18
257	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,556	309,344.55	0.18
258	Constellation Energy Group	联合能源	CEG UN	纽约交易所	美国	1,259	309,288.38	0.18
259	Apollo Group Inc	阿波罗	APOL UQ	纳斯达克交易所	美国	1,094	309,251.36	0.18
260	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所集团	NYX UN	纽约交易所	美国	1,394	309,163.73	0.18
261	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	美国	2,076	309,140.31	0.18
262	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	美国	536	309,137.46	0.18
263	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	美国	1,463	309,033.91	0.18
264	Integrus Energy Group Inc	英迪斯能源集团公司	TEG UN	纽约交易所	美国	921	308,984.21	0.18
265	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	美国	658	308,983.18	0.18
266	Fifth Third	五三银行	FITB UQ	纳斯达克	美国	3,744	308,928.30	0.18

	Bancorp (OH)			交易所				
267	Brown-Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交易所	美国	639	308,869.47	0.18
268	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	美国	925	308,769.74	0.18
269	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	3,055	308,621.22	0.18
270	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	美国	2,464	308,555.53	0.18
271	Apple Inc.	苹果电脑	AAPL UQ	纳斯达克交易所	美国	142	308,469.72	0.18
272	Genworth Financial Inc	Genworth 金融公司	GNW UN	纽约交易所	美国	4,635	308,357.50	0.18
273	3M Co	3M Co	MMM UN	纽约交易所	美国	502	308,143.29	0.18
274	Aon Corp	怡安保险	AON UN	纽约交易所	美国	928	308,089.58	0.18
275	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	美国	1,396	308,071.46	0.18
276	Intel Corp	英特尔	INTC UQ	纳斯达克交易所	美国	2,148	308,046.09	0.18
277	Unum Group	Unum 公司	UNM UN	纽约交易所	美国	1,868	308,026.42	0.18
278	SAIC Inc	SAIC 公司	SAI UN	纽约交易所	美国	2,829	307,943.19	0.18
279	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	美国	2,164	307,819.84	0.18
280	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	美国	771	307,808.65	0.18
281	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	美国	1,735	307,765.67	0.18
282	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	4,338	307,688.86	0.18
283	CH Robinson Worldwide Inc	Charm Communications Inc	CHRW UQ	纳斯达克交易所	美国	603	307,663.23	0.18
284	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	美国	1,629	307,622.46	0.18
285	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	美国	843	307,584.41	0.18
286	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻探公司	DO UN	纽约交易所	美国	675	307,574.12	0.18

287	Kroger Co	Kroger 公司	KR UN	纽约交易所	美国	1,916	307,509.72	0.18
288	Chevron Corp	雪佛龙德士古	CVX UN	纽约交易所	美国	462	307,479.18	0.18
289	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	美国	1,108	307,472.45	0.18
290	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	841	307,453.36	0.18
291	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	美国	1,556	307,431.29	0.18
292	AT&T Inc	美国电话电报集团	T UN	纽约交易所	美国	1,511	307,145.44	0.18
293	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	335	307,138.58	0.18
294	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	美国	447	307,100.20	0.18
295	Berkshire Hathaway B	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B UN	纽约交易所	美国	613	307,013.16	0.18
296	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	美国	1,591	306,933.17	0.18
297	Simon Property Group	Simon Property Group Inc	SPG UN	纽约交易所	美国	408	306,895.18	0.18
298	WellPoint Inc	WellPoint 公司	WLP UN	纽约交易所	美国	602	306,880.30	0.18
299	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,435	306,741.22	0.18
300	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	美国	636	306,719.67	0.18
301	Horton, D. R. Inc	DR Horton Inc	DHI UN	纽约交易所	美国	4,114	306,710.35	0.18
302	Sprint Nextel Corp	斯普林特	S UN	纽约交易所	美国	8,792	306,681.88	0.18
303	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	美国	562	306,675.15	0.18
304	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	美国	1,130	306,630.23	0.18
305	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易所	美国	583	306,513.87	0.18
306	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	美国	588	306,478.93	0.18

307	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼	DIS UN	纽约交易所	美国	1,213	306,465.98	0.18
308	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	美国	821	306,464.43	0.18
309	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	543	306,357.39	0.18
310	TECO Energy Inc	Treaty Energy Corp	TE UN	纽约交易所	美国	2,505	306,232.55	0.18
311	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	美国	968	306,209.19	0.18
312	Public Storage	Public Storage	PSA UN	纽约交易所	美国	415	306,198.25	0.18
313	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	美国	898	306,149.65	0.18
314	Avon Products	雅芳	AVP UN	纽约交易所	美国	1,689	306,054.91	0.18
315	Safeway Inc	Safeway 公司	SWY UN	纽约交易所	美国	2,023	305,961.13	0.18
316	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	美国	792	305,941.52	0.18
317	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	美国	2,408	305,906.32	0.18
318	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	美国	452	305,825.81	0.18
319	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	美国	702	305,702.72	0.18
320	Kraft Foods Inc A	卡夫食品公司	KFT UN	纽约交易所	美国	1,340	305,512.59	0.18
321	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	美国	736	305,505.08	0.18
322	Davita Inc	DaVita 公司	DVA UN	纽约交易所	美国	545	305,475.38	0.18
323	Exxon Mobil Corp	艾克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	美国	580	305,462.11	0.18
324	Patterson Cos Inc	Patterson Cos Inc	PDCO UQ	纳斯达克交易所	美国	1,435	305,441.08	0.18
325	Northeast Utilities	Northeast Utilities	NU UN	纽约交易所	美国	1,341	305,219.88	0.18
326	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	美国	890	305,207.77	0.18
327	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	美国	1,635	305,157.94	0.18

328	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	美国	1,226	305,148.62	0.18
329	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	1,982	305,147.46	0.18
330	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	896	305,119.89	0.18
331	RadioShack Corp	RadioShack 公司	RSH UN	纽约交易所	美国	3,539	304,838.83	0.18
332	Fortune Brands Inc	富俊	FO UN	纽约交易所	美国	738	304,568.12	0.18
333	Molex Inc	Molex 公司	MOLX UQ	纳斯达克交易所	美国	1,826	304,527.74	0.18
334	Covidien Plc	Covidien 公共股份公司	COV UN	纽约交易所	美国	884	304,523.21	0.18
335	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	美国	751	304,392.55	0.18
336	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	美国	1,690	304,376.82	0.18
337	PNC Finl Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交易所	美国	789	304,374.17	0.18
338	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	美国	1,055	304,371.64	0.18
339	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	美国	2,493	304,281.56	0.18
340	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	美国	818	304,179.96	0.18
341	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	美国	1,261	304,148.83	0.18
342	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	美国	1,751	304,144.75	0.18
343	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	美国	667	304,015.12	0.18
344	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	美国	596	303,975.97	0.18
345	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	美国	560	303,952.93	0.18
346	Forest Laboratories	森林实验室	FRX UN	纽约交易所	美国	1,193	303,729.14	0.18
347	Staples Inc	Staples 公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	美国	2,970	303,686.30	0.18
348	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	美国	1,492	303,669.48	0.18

349	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	美国	938	303,639.45	0.18
350	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	美国	972	303,637.38	0.18
351	Yahoo Inc	雅虎	YH00 UQ	纳斯达克交易所	美国	3,119	303,581.20	0.18
352	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	美国	1,041	303,566.32	0.18
353	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	美国	2,040	303,515.45	0.18
354	McGraw-Hill Cos Inc	麦格劳-希尔	MHP UN	纽约交易所	美国	1,119	303,500.50	0.18
355	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	美国	2,341	303,454.81	0.18
356	Donnelley, R. R. & Sons	R. R. 当纳利父子	RRD UQ	纳斯达克交易所	美国	2,391	303,437.21	0.18
357	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	美国	568	303,075.38	0.18
358	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	美国	1,518	303,066.97	0.18
359	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	美国	1,093	303,026.97	0.18
360	Discovery Communications Inc	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	美国	1,143	302,982.71	0.18
361	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	美国	1,354	302,921.23	0.18
362	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	美国	1,755	302,908.74	0.18
363	NICOR Inc	Nicor 公司	GAS UN	纽约交易所	美国	855	302,888.35	0.18
364	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	美国	244	302,881.49	0.18
365	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	美国	1,159	302,873.60	0.18
366	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	美国	780	302,870.88	0.18
367	Frontier Communications Corp	公民通信	FTR UN	纽约交易所	美国	5,798	302,805.26	0.18
368	Motorola Solutions, Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约交易所	美国	1,016	302,719.70	0.18
369	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	美国	1,999	302,719.44	0.18

				所				
370	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	美国	502	302,717.89	0.18
371	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	美国	7,130	302,694.85	0.18
372	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	美国	1,832	302,682.94	0.18
373	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	美国	2,270	302,624.96	0.18
374	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	美国	1,059	302,578.69	0.18
375	E*TRADE Financial Corp	E*Trade 金融	ETFC UQ	纳斯达克交易所	美国	3,388	302,575.78	0.18
376	Wisconsin Energy Corp	威斯康星能源公司	WEC UN	纽约交易所	美国	1,491	302,501.03	0.18
377	CenturyLink Inc	CenturyLink Inc	CTL UN	纽约交易所	美国	1,156	302,463.69	0.18
378	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	美国	1,060	302,452.81	0.18
379	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交易所	美国	1,729	302,449.38	0.18
380	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	美国	710	302,432.11	0.18
381	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	822	302,422.40	0.18
382	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	美国	887	302,399.49	0.18
383	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	美国	1,811	302,377.74	0.18
384	Janus Capital Group Inc	骏利资产管理集团	JNS UN	纽约交易所	美国	4,949	302,343.83	0.18
385	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	美国	1,133	302,238.35	0.18
386	Medco Health Solutions Inc	Medco 保健	MHS UN	纽约交易所	美国	826	302,130.01	0.18
387	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约交易所	美国	1,408	302,063.22	0.18
388	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	美国	1,185	301,922.47	0.18

389	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	美国	1,139	301,774.98	0.18
390	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	美国	844	301,722.56	0.18
391	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	1,383	301,712.01	0.18
392	Becton, Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	美国	541	301,692.85	0.18
393	Health Care REIT Inc	Health Care REIT Inc	HCN UN	纽约交易所	美国	889	301,643.02	0.18
394	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	美国	935	301,639.66	0.18
395	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	美国	1,349	301,628.01	0.18
396	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	美国	5,690	301,583.68	0.18
397	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	美国	557	301,531.58	0.18
398	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	美国	2,366	301,489.45	0.18
399	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	美国	158	301,487.90	0.18
400	Noble Corp	Noble 公司	NE UN	纽约交易所	美国	1,181	301,209.04	0.18
401	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	美国	874	301,134.94	0.18
402	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	美国	1,040	301,120.96	0.18
403	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	美国	699	301,094.04	0.18
404	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	美国	1,340	301,089.90	0.18
405	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	美国	1,492	301,062.46	0.18
406	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	美国	447	300,967.45	0.18
407	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	792	300,816.02	0.18
408	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	2,561	300,813.88	0.18
409	Bard, C. R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	美国	423	300,740.30	0.18
410	Travelers Cos	Travelers Cos	TRV UN	纽约交易所	美国	796	300,738.36	0.18

	Inc	Inc		所				
411	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	840	300,727.49	0.18
412	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	美国	1,592	300,635.33	0.18
413	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股	ZMH UN	纽约交易所	美国	735	300,618.76	0.18
414	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	美国	6,720	300,510.04	0.18
415	CareFusion Corp.	CareFusion Corp	CFN UN	纽约交易所	美国	1,709	300,499.23	0.18
416	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	美国	531	300,377.44	0.18
417	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	美国	688	300,273.96	0.18
418	Target Corp	Target 百货	TGT UN	纽约交易所	美国	989	300,243.35	0.18
419	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	美国	1,231	300,179.21	0.18
420	Lilly, Eli & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	美国	1,235	299,955.75	0.18
421	Life Technologies Corp	Life 科技公司	LIFE UQ	纳斯达克交易所	美国	890	299,908.83	0.18
422	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	美国	2,461	299,898.02	0.18
423	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	美国	1,119	299,807.22	0.18
424	Penney, J.C. Inc	彭尼公司	JCP UN	纽约交易所	美国	1,341	299,752.47	0.18
425	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	2,559	299,750.92	0.18
426	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店	FDO UN	纽约交易所	美国	881	299,669.77	0.18
427	MEMC Electronic Materials	休斯电子材料公司	WFR UN	纽约交易所	美国	5,428	299,640.52	0.18
428	Progress Energy Inc	Progress 能源	PGN UN	纽约交易所	美国	964	299,516.26	0.18
429	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	美国	878	299,501.64	0.18

430	CVS Caremark Corp.	CVS 公司	CVS UN	纽约交易所	美国	1,231	299,382.56	0.18
431	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	美国	870	299,193.72	0.18
432	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	美国	612	299,185.17	0.18
433	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	美国	3,841	299,034.71	0.18
434	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	1,471	299,014.52	0.18
435	Smucker, J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	美国	604	298,792.22	0.18
436	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	美国	570	298,683.11	0.18
437	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,050	298,512.26	0.18
438	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	美国	1,307	298,496.27	0.18
439	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	美国	1,097	298,385.48	0.18
440	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	美国	693	298,330.15	0.18
441	Google Inc	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	美国	91	298,215.08	0.18
442	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	美国	476	298,159.81	0.18
443	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	美国	7,380	298,024.95	0.18
444	National Semiconductor	国家半导体	NSM UN	纽约交易所	美国	1,871	297,986.83	0.18
445	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	美国	1,195	297,974.14	0.18
446	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	美国	1,195	297,974.14	0.18
447	Cephalon Inc	瑟法隆制药股份有限公司	CEPH UQ	纳斯达克交易所	美国	576	297,838.56	0.18
448	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	美国	1,783	297,818.05	0.18
449	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	920	297,753.14	0.18
450	Sears	西尔斯控股	SHLD UQ	纳斯达克	美国	644	297,741.23	0.18

	Holdings Corp			交易所				
451	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	美国	870	297,729.84	0.18
452	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	美国	788	297,562.87	0.18
453	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	美国	1,253	297,516.08	0.18
454	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	美国	418	297,266.60	0.18
455	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	美国	984	297,260.78	0.18
456	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	美国	1,890	297,221.17	0.18
457	Sara Lee Corp	Sara Lee Corp	SLE UN	纽约交易所	美国	2,418	297,161.76	0.18
458	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	美国	621	297,114.59	0.18
459	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	美国	1,491	297,097.50	0.18
460	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	美国	733	297,001.98	0.18
461	Heinz, H. J. Co	亨氏	HNZ UN	纽约交易所	美国	861	296,878.70	0.18
462	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	美国	1,266	296,670.18	0.18
463	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	美国	357	296,650.38	0.18
464	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	美国	5,498	296,388.54	0.18
465	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	美国	1,962	295,973.58	0.18
466	Compuware Corp	Compuware 公司	CPWR UQ	纳斯达克交易所	美国	4,685	295,917.79	0.18
467	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	美国	958	295,606.12	0.18
468	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	1,176	294,910.81	0.17
469	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	美国	518	294,833.80	0.17
470	Lorillard Inc	Lorillard 股份有限公司	LO UN	纽约交易所	美国	418	294,507.37	0.17
471	Philip Morris	菲利普莫里斯	PM UN	纽约交易所	美国	681	294,266.05	0.17

	International	国际集团公司		所				
472	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交易所	美国	917	294,171.04	0.17
473	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	美国	715	294,150.72	0.17
474	The Bank of New York Mellon Corp	纽约银行	BK UN	纽约交易所	美国	1,773	293,967.64	0.17
475	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	美国	1,226	293,961.43	0.17
476	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries Ltd	NBR UN	纽约交易所	美国	1,843	293,885.19	0.17
477	VeriSign Inc	VeriSign Inc	VRSN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,357	293,844.42	0.17
478	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	2,178	293,460.91	0.17
479	Federated Investors Inc B	联合投资	FII UN	纽约交易所	美国	1,901	293,291.88	0.17
480	Washington Post Co B	华盛顿邮报公司	WPO UN	纽约交易所	美国	108	292,817.90	0.17
481	Windstream Corp	Windstream 公司	WIN UQ	纳斯达克交易所	美国	3,488	292,545.31	0.17
482	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics Inc	DGX UN	纽约交易所	美国	764	292,208.27	0.17
483	SanDisk Corp	SanDisk Corp	SNDK UQ	纳斯达克交易所	美国	1,088	292,205.68	0.17
484	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	1,213	292,178.89	0.17
485	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	美国	2,833	292,153.00	0.17
486	Dean Foods Co	Dean 食品公司	DF UN	纽约交易所	美国	3,678	292,057.22	0.17
487	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	美国	1,707	291,751.83	0.17
488	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,600	291,480.86	0.17
489	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	美国	1,185	291,109.39	0.17
490	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	美国	658	290,757.60	0.17

				所				
491	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	美国	337	290,259.87	0.17
492	Northern Trust Corp (IL)	北方信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	975	289,998.87	0.17
493	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	美国	7,211	289,333.59	0.17
494	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UN	纽约交易所	美国	6,395	289,287.32	0.17
495	Express Scripts Inc	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	美国	827	288,901.67	0.17
496	First Horizon National Corp	First Horizon National Corp	FHN UN	纽约交易所	美国	4,673	288,506.65	0.17
497	Archer-Daniels-Midland Co	ADM 公司	ADM UN	纽约交易所	美国	1,464	285,653.84	0.17
498	Walgreen Co	沃尔格林	WAG UN	纽约交易所	美国	1,036	284,676.36	0.17
499	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	5,828	282,119.31	0.17
500	Motorola Mobility Holdings, Inc	Motorola Mobility Holdings Inc	MMI UN	纽约交易所	美国	1,838	262,161.41	0.16

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	National Semiconductor	NSM UN	568,202.97	0.34
2	Cephalon Inc	CEPH UQ	462,179.32	0.27
3	Limited Brands Inc	LTD UN	451,808.57	0.27
4	Abercrombie & Fitch Company A	ANF UN	444,196.34	0.26
5	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	439,144.75	0.26
6	Supervalu Inc	SVU UN	428,981.83	0.25
7	Lorillard Inc	LO UN	426,267.54	0.25
8	Dean Foods Co	DF UN	426,107.58	0.25

9	Citrix Systems Inc	CTXS UQ	405,821.30	0.24
10	Alpha Natural Resources	ANR UN	405,569.53	0.24
11	Aetna Inc	AET UN	403,613.01	0.24
12	GameStop Corp A	GME UN	403,331.12	0.24
13	Constellation Brands Inc A	STZ UN	401,281.59	0.24
14	Electronic Arts	ERTS UQ	400,975.52	0.24
15	Bed Bath & Beyond Inc	BBBY UQ	399,397.22	0.24
16	Macys Inc	M UN	398,212.00	0.24
17	Micron Technology Inc	MU UQ	398,163.10	0.24
18	Expedia	EXPE UQ	395,623.48	0.23
19	Tiffany & Co	TIF UN	395,120.92	0.23
20	Wynn Resorts Ltd	WYNN UQ	394,711.13	0.23

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	National Semiconductor	NSM UN	272,760.20	0.16
2	Cephalon Inc	CEPH UQ	162,998.77	0.10
3	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	133,068.01	0.08
4	Expedia	EXPE UQ	122,274.22	0.07
5	Tiffany & Co	TIF UN	119,401.02	0.07
6	Cabot Oil & Gas A	COG UN	117,148.91	0.07
7	GameStop Corp A	GME UN	112,076.46	0.07
8	Forest Laboratories	FRX UN	109,390.49	0.06
9	Lorillard Inc	LO UN	105,920.55	0.06
10	Dean Foods Co	DF UN	97,261.41	0.06
11	Aetna Inc	AET UN	95,915.78	0.06
12	NetFlix Inc	NFLX UQ	95,400.44	0.06
13	Abercrombie & Fitch Company A	ANF UN	94,498.56	0.06
14	CIGNA Corp	CI UN	87,641.84	0.05
15	Electronic Arts	ERTS UQ	86,213.10	0.05
16	Humana Inc	HUM UN	85,274.34	0.05
17	Salesforce.com	CRM UN	84,880.34	0.05
18	Unitedhealth Group Inc	UNH UN	84,386.82	0.05
19	Constellation Energy Group	CEG UN	82,392.72	0.05
20	Thermo Fisher Scientific	TMO UN	82,143.24	0.05

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关

交易费用。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	173,084,872.16
卖出收入（成交）总额	14,576,476.49

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	190,587.84
4	应收利息	2,103.91
5	应收申购款	55,024.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,715.89

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,676	30,117.12	7,563,518.54	4.42%	163,381,255.89	95.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	44,468.40	0.03%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年3月23日)基金份额总额	822,754,222.26
本报告期基金总申购份额	2,517,817.46
减：本报告期基金总赎回份额	654,327,265.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,944,774.43

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高盛证券	1	70,745,175.90	37.70%	3,265.91	33.72%	-
摩根士丹利	1	49,500,435.74	26.38%	2,388.72	24.66%	-
野村证券	1	37,593,140.63	20.03%	1,737.23	17.94%	-
美林证券	1	29,822,596.29	15.89%	2,293.91	23.68%	-
合计	4	187,661,348.56	100.00%	9,685.77	100.00%	

注：1、中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、本报告期内本基金无退租的交易单元，新增境内交易单元：长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、光大证券、申银万国、华泰联合证券、中银国际、东莞证券、渤海证券、中邮证券、国都证券、国泰君安、华宝证券、国信证券、中航证券、财富证券、华泰证券，新增境外交易单元：高盛证券、摩根士丹利、野村证券、美林证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 17 日
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 17 日
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 17 日
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 17 日
5	关于武汉分公司开通大成标普 500 等权重指数证券投资基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 17 日
6	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金增加华泰证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 2 月 24 日
7	关于开通网上直销赎回转认/申购功能的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 3 日
8	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 15 日
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 3 月 25 日
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 23 日
11	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金在部分代销机构开办定期定额申购业务并参与相关优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 23 日
12	关于开通汇付天天盈账户第三方支付业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 19 日
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 4 月 26 日
14	大成基金管理有限公司关于增加天源证券经纪有限公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 14 日
15	关于旗下部分基金增加浙商银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 18 日
16	关于增加国盛证券有限责任公司为代销机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 25 日
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 5 月 26 日

	定投业务的公告		
18	大成基金管理有限公司关于广州分公司迁址的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 6 月 22 日
19	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成标普 500 等权重指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司
二〇一一年八月二十七日