

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2011 年年度报告
2011 年 12 月 31 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：2012 年 3 月 28 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根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 23 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告.....	14
§ 7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告.....	34
8.1 期末基金资产组合情况	34
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	35
8.4 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.....	36
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	60
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	62
8.7 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.....	62
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	62

8.9 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.....	62
8.10 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.....	62
8.11 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	63
§ 10 开放式基金份额变动.....	63
§ 11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 13 备查文件目录.....	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 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	150,455,310.00 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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 星展银行大厦 3 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2011 年 3 月 23 日-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,161,876.30
本期利润	-18,182,616.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0749
本期加权平均净值利润率	-7.89%
本期基金份额净值增长率	-11.70%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	-17,660,692.99
期末可供分配基金份额利润	-0.1174
期末基金资产净值	132,794,617.01
期末基金份额净值	0.883

3.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-11.70%

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。

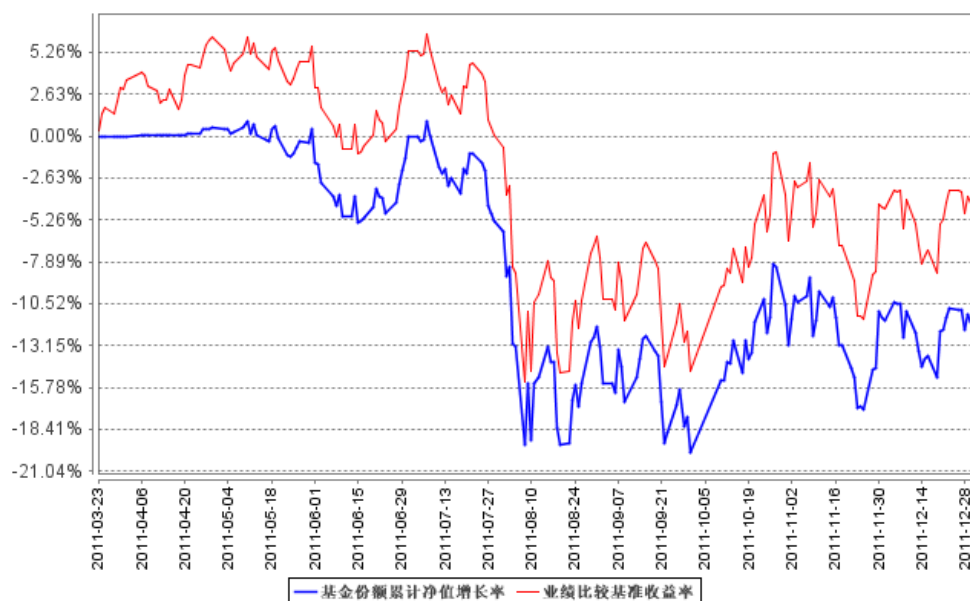
4、本基金合同于2011年3月23日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

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
过去三个月	10.24%	1.83%	12.45%	1.92%	-2.21%	-0.09%
过去六个月	-10.45%	2.03%	-7.59%	2.14%	-2.86%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-11.70%	1.67%	-4.14%	1.79%	-7.56%	-0.12%

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

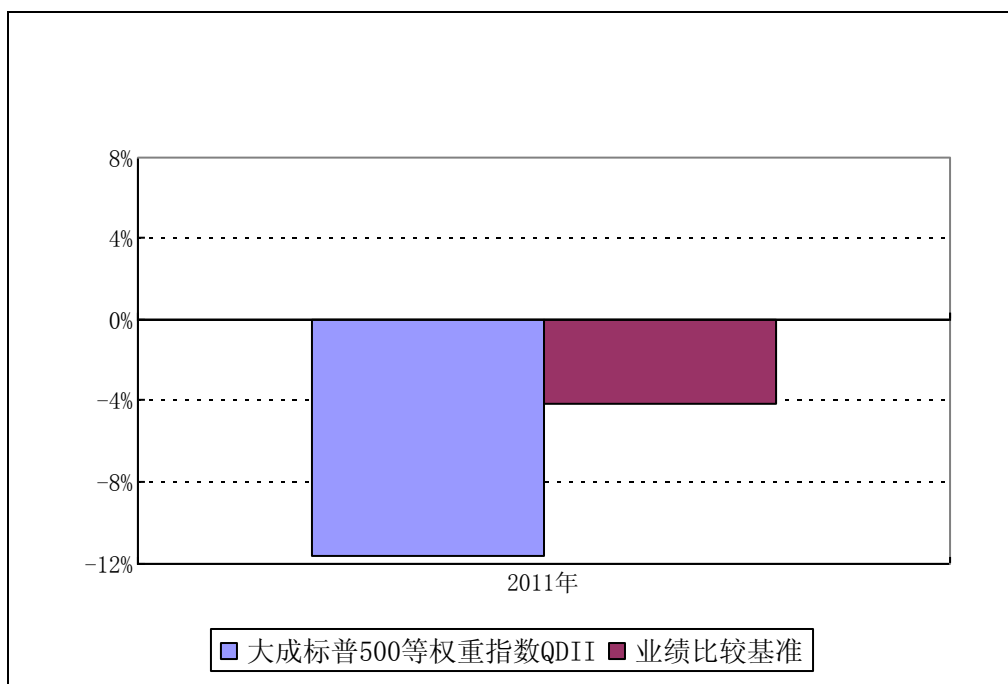


注：1、本基金合同于2011年3月23日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2011年净值增长率表现期间为2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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12月31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19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、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金。

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	2011年8月25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日至2011年8月25日任大成标普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。
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011年8月26日	-	8年	金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员；2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融

					工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011 年 8 月 26 日开始担任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。
--	--	--	--	--	---

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

本基金管理人严格执行《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

2011 年，国际经济与股票市场波澜起伏。在 2010 年底与 2011 年初，美国的经济曾经一度呈

现出加速增长的势态。可是，从 2011 年 1 季度开始，国际政治经济形势发生了巨大的不利变化。首先，在中东及北非方面，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；其次，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；更为严重的是，在欧洲方面，欧债危机导致欧洲金融市场持续剧烈动荡；另外，美国受制于国债上限的规定及控制财政赤字的需要，政府也大规模减少财政支出。

尤其是在第 3 季度中，欧洲主权债务危机愈演愈烈。其间，不仅希腊等小国的问题并未得到彻底的解决，而且意大利及西班牙这两个欧元区主要经济体的主权债务危机也在持续恶化。同时，标普公司也下调了美国国债的信用评级，使得标普体系中的美国 AAA 评级不复存在。

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，致使美国 2011 年 1-3 季度的 GDP 季环比年化增长率分别为 0.4%、1.3%及 1.8%，严重低于潜在经济增长速度。

前三季度恶劣的全球宏观金融形势使得美国股票市场在 2 季度及 3 季度出现大幅下挫，尤其是在 3 季度，以欧债危机的持续恶化及美国主权债券评级下调等因素为导火索，使美国股票市场出现了快速的大幅下滑，本基金所跟踪的标的指数也同样出现大幅下跌。

至 2011 年 4 季度，美国宏观经济的表现却是较为出色。2011 年上半年影响经济复苏的临时性因素在 4 季度都将逐步减弱，同时无论是美国政府、居民还是企业部门的资产负债表也均未出现明显的恶化。在此背景下，4 季度美国宏观经济不仅未出现二次衰退的情形，而且其 GDP 增速还回到 2.8%的水平。在相对较好的宏观经济下，标普 500 指数成份公司企业盈利在 4 季度也保持持续增长。因此，4 季度美国股票市场表现在全球主要市场中一枝独秀，本基金的目标指数也随之大幅反弹。

由于本基金的投资标的是美元资产，而本基金的记账货币是人民币，因此美元兑人民币汇率的变化也会对基金表现造成一定影响。2011 年的前 10 个月，美元兑人民币汇率持续下跌，因此对本基金净值造成一定的负面影响，而 11 月以来，人民币升值步伐暂缓，汇率因素对本基金净值造成的负面影响较小。

基金经理秉承被动化指数基金管理原则，在投资操作上不作时机选择，因此在建仓期过后较好地跟踪了经汇率调整后的跟踪基准指数。

从本基金成立之日起，基准指数下跌 5.83%，同期美元兑人民币汇率下跌 3.92%，即经过汇率调整后的基准指数下跌 9.52%；同期，本基金净值下跌 11.70%，低于经汇率调整后的基准指数 2.18%。本基金收益率略低于经汇率调整后的基准指数的主要原因在于基金各项费用的影响及建仓期内基金收益率较低的影响。

建仓期过后，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 2.24%，日均偏差绝对值为 0.10%，均

显著低于本基金合同中的目标值。

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 0.883 元，本报告期（自基金合同生效至今）基金份额净值增长率为-11.70%，同期业绩比较基准收益率为-4.14%，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 2012 年，全球宏观经济状况虽然还有很大的不确定性，但有望好于 2011 年。

从不利因素来看，首先欧洲主权债务危机有可能还会持续深化，意大利及西班牙在 4 月份之前都有较高金额的国债拍卖，其结果会严重影响金融市场的走势。其次，伊朗局势的紧张程度持续升温。作为全球重要石油输出国，如果伊朗局势进一步恶化，国际原油价格有可能飙升，给国际经济造成严重的不利影响。

但是，尽管在上述不利的国际背景下，作为全球经济的最大主体，美国经济依然有望保持正增长，但增速可能会低于其潜在经济增长速度。从美国居民部门来看，居民杠杆水平较之 2007 年有了大幅的下降，储蓄率也回升到了历史平均水平之上；从企业部门来看，企业手持大量现金，且盈利增长依然稳健；房地产市场经过数年的调整，房产泡沫基本挤压完毕；相对而言美国政府的资产负债表状况相对较差，但也不会爆发美国政府信用危机，只是会通过减少政府支出对经济造成小幅的负面影响。综上所述，在欧债危机及伊朗形势都可控的情况下，美国经济仍会实现正增长，本基金基准指数的成份股企业盈利也会随之持续增加。

本基金为被动型指数基金，其投资目标就是要复制指数的收益率。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，以期更好的跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的制度，并对以前的制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基

金管理人组织各部门对管理制度作了进一步梳理和完善。

(二) 全面加强风险监控, 不断提高基金业务风险管理水平。本年度内, 公司在原有的基础上进一步提升内控管理水平, 优化内控管理质量。公司新设风险管理部, 进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力。同时, 为督促各部门完善并落实各项内控措施, 公司继续完善风险控制管理员制度, 健全内控工作协调机制及监督机制, 有效防范相关业务风险。

(三) 日常监察和专项监察相结合, 确保监察稽核的有效性和深入性。本年度, 公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查, 对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控, 同时, 还专门针对基金投资交易(包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等)、基金运营(基金头寸、基金结算、登记清算等)、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察, 保证了公司监察的全面性、实时性, 通过专项监察, 及时发现并纠正了业务中的潜在风险, 加强了业务部门和人员的风险意识, 从而较好地预防了风险的发生。

(四) 加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理, 定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查, 有效的防范了各种形式的利益输送行为。

(五) 以多种方式加强合规教育与培训, 提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规, 并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题, 提供法律依据, 对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门, 避免了业务发展中的盲目性, 及时防范风险, 维护了基金份额持有人的利益。

4.8 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、研究部、固定收益部、风险管理部、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, 估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理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。

4.9 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、基金份额申购赎回价格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 托管人对本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、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人

引言段	我们审计了后附的 大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下简称“大成标普 500 等权重指数基金”）的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是大成标普 500 等权重指数基金的基金管理人 大成基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述大成标普 500 等权重指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成标普 500 等权重指数基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪棣、金毅
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2012 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	8,206,414.51
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	125,728,789.60
其中：股票投资		125,728,789.60
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		363,326.40
应收利息	7.4.7.5	746.12
应收股利		191,040.70
应收申购款		156,946.28
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		134,647,263.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,485,945.78
应付管理人报酬		113,815.16
应付托管费		28,453.78
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	224,431.88
负债合计		1,852,646.60
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	150,455,310.00
未分配利润	7.4.7.10	-17,660,692.99
所有者权益合计		132,794,617.01
负债和所有者权益总计		134,647,263.61

注：1. 报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.883 元，基金份额总额 150,455,310.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		-15,583,925.99
1. 利息收入		2,356,005.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,356,005.74
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）		-1,428,430.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,051,515.07
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,623,084.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-17,020,740.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-350,624.56
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	859,863.79
减：二、费用		2,598,690.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,795,790.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	448,947.57

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	81,077.81
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	272,875.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,182,616.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,182,616.98

7.3 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12月31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12月31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）	-	-18,182,616.98	-18,182,616.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-672,298,912.26	521,923.99	-671,776,988.27
其中：1. 基金申购款	18,385,817.26	-2,373,174.11	16,012,643.15
2. 基金赎回款	-690,684,729.52	2,895,098.10	-687,789,631.42
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）	150,455,310.00	-17,660,692.99	132,794,617.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

 王颢
 基金管理公司负责人

 刘彩晖
 主管会计工作负责人

 范瑛
 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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]第 1876 号《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 份基金份额,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,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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,本基金的投资范围为标普 500 等权重指数成份股、备选成份股,与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等,固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。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)。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2012 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间,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12月31日的财务状况以及2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

本基金目前持有的股票投资和衍生工具(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。本基金目前暂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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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；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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即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。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。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期间无须说明其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日
活期存款	8,206,414.51
定期存款	-

其他存款	-
合计:	8,206,414.51

注：于2011年12月31日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款765,020.00元(折合人民币4,820,314.52元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	142,749,530.28	125,728,789.60	-17,020,740.68
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	142,749,530.28	125,728,789.60	-17,020,740.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日
应收活期存款利息	746.12
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	746.12

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日
应付赎回费	5,600.24
预提信息披露费	75,000.00
预提审计费	72,000.00
预提指数使用费	71,831.64
合计	224,431.88

7.4.7.9 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12月31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	18,385,817.26	18,385,817.26
本期赎回(以“-”号填列)	-690,684,729.52	-690,684,729.52
本期末	150,455,310.00	150,455,310.00

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。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元在本基金成立后，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基金合同》及《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，自2011年4月25日起开始办理本基金申购以及赎回业务。

7.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	-1,161,876.30	-17,020,740.68	-18,182,616.98
本期基金份额交易产生的变动数	-1,248,101.06	1,770,025.05	521,923.99

其中：基金申购款	-82,237.50	-2,290,936.61	-2,373,174.11
基金赎回款	-1,165,863.56	4,060,961.66	2,895,098.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,409,977.36	-15,250,715.63	-17,660,692.99

7.4.7.11 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12月31日	
活期存款利息收入	306,085.98	
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	44.76	
合计	2,356,005.74	

7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	
卖出股票成交总额	43,516,376.30	
卖出股票成本总额	46,567,891.37	
买卖股票差价收入	-3,051,515.07	

7.4.7.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 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12月31日	
股票投资产生的股利收益	1,623,084.79	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	1,623,084.79	

7.4.7.16 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日至(基金合同生效日)2011年12月31日	
1. 交易性金融资产	-17,020,740.68	

——股票投资	-17,020,740.68
——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	-17,020,740.68

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年3月23日至(基金合同生效日)2011年12月31日
基金赎回费收入	859,740.61
其他	123.18
合计	859,863.79

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。

7.4.7.18 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12月31日
交易所市场交易费用	81,077.81
银行间市场交易费用	-
合计	81,077.81

7.4.7.19 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12月31日
审计费用	72,000.00
信息披露费	75,000.00
银行汇划费	13,065.98
指数使用费	111,909.48
其他	900.00
合计	272,875.46

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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)股份有限公司 (“中银香港”)	境外资产托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,795,790.15
其中：支付销售机构的客户维护费	724,423.62

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 X 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	448,947.57

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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,387,180.09	2,355,960.98
中银香港	4,819,234.42	-
合计	8,206,414.51	2,355,960.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配。

7.4.12 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、风险管理部)、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。风险管理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。

7.4.13.2 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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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，与该等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，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 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，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的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%。本基金所持大部分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约约定到期日均为一个月以内，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,206,414.51	-	-	-	8,206,414.51
交易性金融资产	-	-	-	125,728,789.60	125,728,789.60
应收证券清算款	-	-	-	363,326.40	363,326.40

应收利息	-	-	-	746.12	746.12
应收股利	-	-	-	191,040.70	191,040.70
应收申购款	63,875.66	-	-	93,070.62	156,946.28
资产总计	8,270,290.17	-	-	126,376,973.44	134,647,263.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,485,945.78	1,485,945.78
应付管理人报酬	-	-	-	113,815.16	113,815.16
应付托管费	-	-	-	28,453.78	28,453.78
其他负债	-	-	-	224,431.88	224,431.88
负债总计	-	-	-	1,852,646.60	1,852,646.60
利率敏感度缺口	8,270,290.17	-	-	124,524,326.84	132,794,617.01

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2011年12月31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。

7.4.13.4.2 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	4,820,314.52	-	-	4,820,314.52
交易性金融资产	125,728,789.60	-	-	125,728,789.60
应收股利	191,040.70	-	-	191,040.70
应收证券清算款	363,326.40	-	-	363,326.40
资产合计	131,103,471.22	-	-	131,103,471.22
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	131,103,471.22	-	-	131,103,471.22

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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12月31日	
	美元相对人民币升值 5%		增加约 656
	美元相对人民币贬值 5%		减少约 656

7.4.13.4.3 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%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2011年12月31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	125,728,789.60	94.68
衍生金融资产—权证投资	-	0.00
其他	-	0.00
合计	125,728,789.60	94.68

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日	
1. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	增加约 614	
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	下降约 614	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 125,728,789.60 元, 无属于第二层级和第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	125,728,789.60	93.38
	其中: 普通股票	125,728,789.60	93.38

	存托凭证	-	0.00
	优先股	-	0.00
	房地产信托凭证	-	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	8,206,414.51	6.09
8	其他各项资产	712,059.50	0.53
9	合计	134,647,263.61	100.00

8.2 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	125,728,789.60	94.68
合计	125,728,789.60	94.68

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	20,487,167.21	15.43
消费者非必需品	20,132,756.88	15.16
信息技术	17,686,923.06	13.32
工业	15,388,918.65	11.59
医疗保健	13,171,912.49	9.92
能源	10,615,166.31	7.99
消费者常用品	10,539,158.34	7.94
公用事业	8,402,173.73	6.33
基础材料	7,515,893.14	5.66
电信服务	1,788,719.79	1.35
合计	125,728,789.60	94.68

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

8.4 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 列(%)
1	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	1,461	297,157.25	0.22
2	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	US	8,778	283,736.71	0.21
3	Masco Corp	马斯可公司	MAS UN	纽约交易所	US	4,251	280,708.12	0.21
4	Cintas Corp	Cintas 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	US	1,265	277,457.93	0.21
5	DeVry Inc	迪弗莱公司	DV UN	纽约交易所	US	1,137	275,532.18	0.21
6	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股公司	ZMH UN	纽约交易所	US	816	274,660.77	0.21
7	Intl Game Technology	国际游戏技术公司	IGT UN	纽约交易所	US	2,533	274,515.09	0.21
8	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	US	300	274,051.34	0.21
9	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	3,056	273,813.93	0.21
10	Micron Technology Inc	美光技术公司	MU UQ	纳斯达克交易所	US	6,861	271,919.69	0.20
11	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	US	2,114	271,863.29	0.20
12	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	1,480	270,621.13	0.20
13	Yahoo Inc	雅虎公司	YHOO UQ	纳斯达克交易所	US	2,662	270,548.42	0.20
14	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	US	7,815	270,336.02	0.20
15	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF UN	纽约交易所	US	9,965	269,990.41	0.20
16	Gilead Sciences Inc	Gilead 科学公司	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	1,044	269,243.25	0.20

17	JDS Uniphase Corp	捷迪讯公司	JDSU UQ	纳斯达克交易所	US	4,089	268,980.13	0.20
18	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	6,761	268,808.43	0.20
19	LSI Corporation	LSI 公司	LSI UN	纽约交易所	US	7,158	268,355.96	0.20
20	CBS Corp B	维亚康姆公司	CBS UN	纽约交易所	US	1,567	267,967.07	0.20
21	CVS Caremark Corp.	CVS 公司	CVS UN	纽约交易所	US	1,037	266,457.88	0.20
22	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	1,117	266,251.52	0.20
23	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	1,110	266,051.72	0.20
24	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	US	1,138	266,022.74	0.20
25	Medtronic Inc	美敦力公司	MDT UN	纽约交易所	US	1,103	265,833.40	0.20
26	Intl Paper Co	国际纸业公司	IP UN	纽约交易所	US	1,424	265,585.46	0.20
27	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	688	265,519.93	0.20
28	Halliburton Co	哈利伯顿公司	HAL UN	纽约交易所	US	1,221	265,499.20	0.20
29	Supervalu Inc	Supervalu 公司	SVU UN	纽约交易所	US	5,183	265,179.43	0.20
30	Starwood Hotel & Resort World	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	US	876	264,774.66	0.20
31	Omnicom Group	奥姆尼康集团	OMC UN	纽约交易所	US	942	264,602.26	0.20
32	First Horizon National Corp	First Horizon National 公司	FHN UN	纽约交易所	US	5,248	264,536.99	0.20
33	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔公司	NWL UN	纽约交易所	US	2,598	264,371.27	0.20
34	Penney, J.C. Inc	彭尼公司	JCP UN	纽约交易所	US	1,193	264,221.63	0.20
35	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	2,574	264,037.45	0.20
36	DTE Energy Co	DTE 能源公司	DTE UN	纽约交易所	US	768	263,488.52	0.20
37	Apollo Group Inc	阿波罗公司	APOL UQ	纳斯达克交易所	US	776	263,397.28	0.20

38	Weyerhaeuser Co	惠好公司	WY UN	纽约交易所	US	2,239	263,391.04	0.20
39	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默公司	PKI UN	纽约交易所	US	2,089	263,251.60	0.20
40	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	5,424	262,814.07	0.20
41	Stanley Black & Decker	史丹利 Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	US	617	262,805.50	0.20
42	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	4,284	262,642.43	0.20
43	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	90	262,564.17	0.20
44	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	1,750	262,542.75	0.20
45	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	7,494	262,537.33	0.20
46	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	2,354	262,532.04	0.20
47	AT&T Inc	美国电话电报集团	T UN	纽约交易所	US	1,377	262,372.50	0.20
48	Marathon Oil Corp	马拉松石油公司	MRO UN	纽约交易所	US	1,422	262,255.68	0.20
49	Amgen Inc	安进公司	AMGN UQ	纳斯达克交易所	US	648	262,168.35	0.20
50	Chevron Corp	雪佛龙德士古公司	CVX UN	纽约交易所	US	391	262,132.56	0.20
51	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	US	464	261,605.30	0.20
52	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	US	1,256	261,317.98	0.20
53	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	US	569	261,254.41	0.20
54	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	2,805	261,045.34	0.20
55	El Paso Corp	埃尔帕索能源公司	EP UN	纽约交易所	US	1,559	260,999.85	0.20
56	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	743	260,950.64	0.20
57	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼公司	NOC UN	纽约交易所	US	708	260,881.46	0.20
58	Block H	H&R Block	HRB UN	纽约交易所	US	2,535	260,835.52	0.20

	& R Inc	公司		所				
59	Hershey Foods Corp	好时食品公司	HSY UN	纽约交易所	US	670	260,810.63	0.20
60	Simon Property Group	Simon Property 集团	SPG UN	纽约交易所	US	321	260,792.61	0.20
61	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	855	260,636.10	0.20
62	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	832	260,597.16	0.20
63	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	US	616	260,555.32	0.20
64	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	US	998	260,524.19	0.20
65	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼公司	DIS UN	纽约交易所	US	1,102	260,384.69	0.20
66	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	765	260,338.38	0.20
67	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	6,610	260,305.93	0.20
68	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	1,499	260,305.55	0.20
69	Celgene Corp	Celgene 公司	CELG UQ	纳斯达克交易所	US	611	260,249.85	0.20
70	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车公司	HOG UN	纽约交易所	US	1,062	260,100.77	0.20
71	Aon Corp	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	882	260,086.03	0.20
72	Johnson Controls Inc	江森自控公司	JCI UN	纽约交易所	US	1,320	259,995.30	0.20
73	Lockheed Martin	洛克希德马丁公司	LMT UN	纽约交易所	US	510	259,968.83	0.20
74	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	831	259,917.42	0.20
75	Baker Hughes Inc	贝克休斯公司	BHI UN	纽约交易所	US	848	259,891.46	0.20
76	TECO Energy Inc	TECO 能源公司	TE UN	纽约交易所	US	2,155	259,891.33	0.20
77	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	1,598	259,776.03	0.20
78	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	1,994	259,697.77	0.20
79	Union Pacific	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	US	389	259,664.25	0.20

	Corp	公司		所				
80	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 公司	CMG UN	纽约交易所	US	122	259,624.05	0.20
81	Leggett & Platt	礼恩派公司	LEG UN	纽约交易所	US	1,788	259,568.85	0.20
82	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	US	1,220	259,516.43	0.20
83	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	907	259,514.35	0.20
84	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	895	259,464.45	0.20
85	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	1,124	259,421.41	0.20
86	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	788	259,327.65	0.20
87	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	550	259,322.99	0.20
88	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品公司	APD UN	纽约交易所	US	483	259,261.68	0.20
89	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	US	951	259,220.66	0.20
90	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森公司	AVY UN	纽约交易所	US	1,434	259,137.87	0.20
91	Exxon Mobil Corp	艾克森美孚石油公司	XOM UN	纽约交易所	US	485	259,021.18	0.20
92	Ecolab Inc	艺康化工公司	ECL UN	纽约交易所	US	711	258,985.33	0.20
93	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	474	258,910.66	0.19
94	Washington Post Co B	华盛顿邮报公司	WPO UN	纽约交易所	US	109	258,792.39	0.19
95	CenturyLink Inc	CenturyLink 公司	CTL UN	纽约交易所	US	1,104	258,770.40	0.19
96	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	2,023	258,758.43	0.19
97	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯公司	SHW UN	纽约交易所	US	460	258,741.42	0.19
98	Patterson Cos Inc	Patterson Cos 公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,391	258,729.57	0.19
99	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	3,226	258,555.67	0.19

100	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	2,117	258,509.92	0.19
101	Becton, Dickinson & Co	碧迪公司	BDX UN	纽约交易所	US	549	258,470.98	0.19
102	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UN	纽约交易所	US	7,596	258,452.84	0.19
103	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	US	619	258,431.04	0.19
104	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	US	477	258,385.35	0.19
105	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	910	258,365.88	0.19
106	General Electric Co	通用电气公司	GE UN	纽约交易所	US	2,289	258,311.63	0.19
107	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	537	258,302.75	0.19
108	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	US	940	258,295.31	0.19
109	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	990	258,248.69	0.19
110	CareFusion Corp.	CareFusion 公司	CFN UN	纽约交易所	US	1,612	258,090.66	0.19
111	CMS Energy Corp	CMS 能源公司	CMS UN	纽约交易所	US	1,855	258,074.78	0.19
112	Caterpillar Inc	卡特彼勒公司	CAT UN	纽约交易所	US	452	258,029.42	0.19
113	Genuine Parts Co	原配部件公司	GPC UN	纽约交易所	US	669	257,976.49	0.19
114	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	1,240	257,910.96	0.19
115	Horton, D. R. Inc	DR Horton 公司	DHI UN	纽约交易所	US	3,245	257,829.36	0.19
116	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	672	257,778.39	0.19
117	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	616	257,760.75	0.19
118	Hospira, Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	US	1,347	257,759.67	0.19
119	Allergan Inc	爱力根公司	AGN UN	纽约交易所	US	466	257,623.89	0.19
120	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	583	257,580.54	0.19
121	Robert Half	Robert	RHI UN	纽约交易	US	1,436	257,508.71	0.19

	Intl Inc	Half 国际 公司		所				
122	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易 所	US	248	257,504.68	0.19
123	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易 所	US	436	257,411.93	0.19
124	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price 公司	TROW UQ	纳斯达克 交易所	US	717	257,285.59	0.19
125	Abercrombie & Fitch Company A	阿贝克隆比 &费奇公司	ANF UN	纽约交易 所	US	836	257,267.26	0.19
126	Molex Inc	Molex 公司	MOLX UQ	纳斯达克 交易所	US	1,711	257,230.84	0.19
127	Eastman Chemical Co	伊士曼化工 公司	EMN UN	纽约交易 所	US	1,045	257,188.25	0.19
128	Sunoco Inc	太阳石油公 司	SUN UN	纽约交易 所	US	995	257,170.60	0.19
129	Integrays Energy Group Inc	英迪斯能源 集团公司	TEG UN	纽约交易 所	US	753	257,061.22	0.19
130	Health Care REIT Inc	Health Care REIT 公司	HCN UN	纽约交易 所	US	748	257,003.88	0.19
131	McGraw-Hill Cos Inc	麦格希公司	MHP UN	纽约交易 所	US	907	256,999.79	0.19
132	Noble Energy Inc	Noble 能源 股份有限公 司	NBL UN	纽约交易 所	US	432	256,928.52	0.19
133	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克 交易所	US	845	256,895.57	0.19
134	Duke Energy Corp	杜克能源公 司	DUK UN	纽约交易 所	US	1,853	256,862.49	0.19
135	Dominion Resources Inc	多米诺资源 公司	D UN	纽约交易 所	US	768	256,858.96	0.19
136	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易 所	US	1,131	256,832.50	0.19
137	Ryder System Inc	Ryder 系统 公司	R UN	纽约交易 所	US	767	256,814.48	0.19
138	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与 管理	AIV UN	纽约交易 所	US	1,779	256,805.09	0.19
139	Lennar Corp	Lennar 公 司	LEN UN	纽约交易 所	US	2,074	256,787.51	0.19
140	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易 所	US	1,619	256,763.12	0.19
141	Genworth	Genworth	GNW UN	纽约交易	US	6,221	256,746.24	0.19

	Financial Inc	金融公司		所				
142	Public Storage	Public Storage 公司	PSA UN	纽约交易所	US	303	256,707.36	0.19
143	Xcel Energy Inc	Xcel 能源公司	XEL UN	纽约交易所	US	1,474	256,707.24	0.19
144	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	US	739	256,705.41	0.19
145	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne 公司	HP UN	纽约交易所	US	698	256,668.93	0.19
146	PNC Finl Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交易所	US	706	256,541.27	0.19
147	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	1,324	256,528.54	0.19
148	Avon Products	雅芳公司	AVP UN	纽约交易所	US	2,330	256,478.76	0.19
149	Fluor Corp	福陆公司	FLR UN	纽约交易所	US	810	256,462.38	0.19
150	Wisconsin Energy Corp	威斯康星能源公司	WEC UN	纽约交易所	US	1,164	256,405.30	0.19
151	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	US	1,228	256,343.55	0.19
152	Dean Foods Co	Dean 食品公司	DF UN	纽约交易所	US	3,632	256,310.53	0.19
153	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	US	2,085	256,310.22	0.19
154	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	2,280	256,290.37	0.19
155	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	896	256,254.07	0.19
156	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	US	368	256,196.61	0.19
157	Time Warner Inc	时代华纳公司	TWX UN	纽约交易所	US	1,125	256,178.84	0.19
158	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	468	256,164.10	0.19
159	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	US	575	256,147.34	0.19
160	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	806	256,110.04	0.19
161	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克	US	1,676	256,087.48	0.19

				交易所				
162	Discovery Communications Inc	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	992	256,082.69	0.19
163	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	228	256,060.51	0.19
164	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶公司	GT UN	纽约交易所	US	2,867	255,976.52	0.19
165	Grainger, W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	US	217	255,944.01	0.19
166	Progress Energy Inc	Progress 能源公司	PGN UN	纽约交易所	US	725	255,907.90	0.19
167	Frontier Communications Corp	公民通信公司	FTR UQ	纳斯达克交易所	US	7,886	255,897.82	0.19
168	Cooper Industries Plc	库珀工业公开有限公司	CBE UN	纽约交易所	US	750	255,895.30	0.19
169	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克交易所	US	582	255,891.90	0.19
170	Beam Inc	Beam 公司	BEAM UN	纽约交易所	US	792	255,653.72	0.19
171	Alpha Natural Resources	阿尔法自然资源股份有限公司	ANR UN	纽约交易所	US	1,986	255,652.59	0.19
172	Assurant Inc	Assurant 公司	AIZ UN	纽约交易所	US	988	255,610.37	0.19
173	Hess Corp	阿美拉达赫斯公司	HES UN	纽约交易所	US	714	255,534.26	0.19
174	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	US	868	255,465.45	0.19
175	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品公司	STJ UN	纽约交易所	US	1,182	255,454.87	0.19
176	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	US	1,648	255,443.53	0.19
177	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜公司	TAP UN	纽约交易所	US	931	255,411.64	0.19
178	Sprint Nextel Corp	斯普林特公司	S UN	纽约交易所	US	17,320	255,367.92	0.19
179	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	US	981	255,344.67	0.19
180	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	US	399	255,252.42	0.19
181	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	US	1,408	255,149.15	0.19

182	US Bancorp	US Bancorp 公司	USB UN	纽约交易 所	US	1,497	255,147.70	0.19
183	Merck & Co Inc	默克公司	MRK UN	纽约交易 所	US	1,074	255,122.18	0.19
184	Home Depot Inc	家得宝公司	HD UN	纽约交易 所	US	963	255,088.91	0.19
185	Agilent Technologies Inc	安捷伦公司	A UN	纽约交易 所	US	1,159	255,084.82	0.19
186	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 公司	MMC UN	纽约交易 所	US	1,280	255,020.11	0.19
187	Aetna Inc	安泰保险公 司	AET UN	纽约交易 所	US	959	254,935.74	0.19
188	Southern Co	南方公司	SO UN	纽约交易 所	US	874	254,918.41	0.19
189	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易 所	US	360	254,778.15	0.19
190	Northeast Utilities	Northeast Utilities 公司	NU UN	纽约交易 所	US	1,121	254,773.55	0.19
191	Forest Laboratories	森林实验室	FRX UN	纽约交易 所	US	1,336	254,728.75	0.19
192	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克 交易所	US	739	254,703.17	0.19
193	Metropcs Communications Inc	MetroPCS 通信有限公 司	PCS UN	纽约交易 所	US	4,657	254,699.77	0.19
194	Invesco Ltd	景顺有限公 司	IVZ UN	纽约交易 所	US	2,012	254,689.18	0.19
195	Philip Morris International	菲利普莫里 斯国际集团 公司	PM UN	纽约交易 所	US	515	254,664.74	0.19
196	Marathon Petroleum Corp.	Marathon Petroleum 公司	MPC UN	纽约交易 所	US	1,214	254,644.95	0.19
197	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易 所	US	626	254,608.66	0.19
198	The Bank of New York Mellon Corp	纽约银行	BK UN	纽约交易 所	US	2,029	254,539.91	0.19
199	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食 品公司	CAG UN	纽约交易 所	US	1,530	254,505.95	0.19
200	Republic Services Inc	公共服务公 司	RSG UN	纽约交易 所	US	1,466	254,482.64	0.19
201	National Oilwell	美国国民油	NOV UN	纽约交易	US	594	254,468.53	0.19

	Varco Inc	井公司		所				
202	Macys Inc	联合百货公司	M UN	纽约交易所	US	1,255	254,467.52	0.19
203	Xylem Inc	Xylem 公司	XYL UN	纽约交易所	US	1,572	254,459.83	0.19
204	Constellation Energy Group	联合能源公司	CEG UN	纽约交易所	US	1,018	254,455.92	0.19
205	Ford Motor Co	福特汽车公司	F UN	纽约交易所	US	3,753	254,444.71	0.19
206	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生公司	ED UN	纽约交易所	US	651	254,439.98	0.19
207	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	US	1,465	254,401.36	0.19
208	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	494	254,396.44	0.19
209	Allstate Corp	全州保险公司	ALL UN	纽约交易所	US	1,472	254,225.69	0.19
210	Brown-Forman Corp B	布朗福曼公司	BF/B UN	纽约交易所	US	501	254,150.01	0.19
211	Davita Inc	DaVita 公司	DVA UN	纽约交易所	US	532	254,121.09	0.19
212	Boston Scientific Corp	波士顿科学公司	BSX UN	纽约交易所	US	7,548	253,966.09	0.19
213	Gannett Co Inc	甘乃特公司	GCI UN	纽约交易所	US	3,014	253,908.50	0.19
214	Covidien Plc	Covidien 公共股份公司	COV UN	纽约交易所	US	895	253,825.14	0.19
215	MeadWestvaco Corp	MeadWestvaco 公司	MWV UN	纽约交易所	US	1,345	253,817.58	0.19
216	Verizon Communications Inc	Verizon 通信公司	VZ UN	纽约交易所	US	1,004	253,803.28	0.19
217	Schwab, Charles Corp	嘉信理财公司	SCHW UN	纽约交易所	US	3,576	253,710.53	0.19
218	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	US	2,477	253,619.10	0.19
219	Xilinx Inc	赛灵思公司	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	1,255	253,518.60	0.19
220	McCormick & Co	味好美公司	MKC UN	纽约交易所	US	798	253,517.72	0.19
221	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	US	835	253,487.10	0.19
222	Dover Corp	多佛公司	DOV UN	纽约交易	US	693	253,476.70	0.19

				所				
223	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	3,756	253,464.79	0.19
224	ProLogis, Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	US	1,407	253,460.82	0.19
225	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业公司	PCL UN	纽约交易所	US	1,100	253,396.99	0.19
226	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	US	459	253,378.03	0.19
227	Teradyne Inc	泰瑞达公司	TER UN	纽约交易所	US	2,950	253,349.74	0.19
228	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	1,768	253,323.40	0.19
229	Kellogg Co	家乐氏公司	K UN	纽约交易所	US	795	253,316.03	0.19
230	Boeing Co	波音公司	BA UN	纽约交易所	US	548	253,269.72	0.19
231	E*TRADE Financial Corp	E*Trade 金融公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	5,048	253,183.27	0.19
232	Eaton Corp	伊顿公司	ETN UN	纽约交易所	US	923	253,158.76	0.19
233	Quest Diagnostics	Quest Diagnostic s 公司	DGX UN	纽约交易所	US	692	253,154.54	0.19
234	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries 公司	NBR UN	纽约交易所	US	2,317	253,149.87	0.19
235	Travelers Cos Inc	Travelers Cos 公司	TRV UN	纽约交易所	US	679	253,147.67	0.19
236	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	US	546	253,067.84	0.19
237	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	US	481	253,035.89	0.19
238	Allegheny Technologies Inc	冶联科技公司	ATI UN	纽约交易所	US	840	252,993.74	0.19
239	Norfolk Southern Corp	诺福克南方公司	NSC UN	纽约交易所	US	551	252,955.05	0.19
240	Analog Devices Inc	模拟器件公司	ADI UN	纽约交易所	US	1,122	252,950.64	0.19
241	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约交易所	US	1,063	252,911.07	0.19
242	Ball Corp	波尔公司	BLL UN	纽约交易所	US	1,124	252,905.78	0.19

243	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	US	522	252,797.90	0.19
244	Stryker Corp	史赛克公司	SYK UN	纽约交易所	US	807	252,766.72	0.19
245	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	US	1,862	252,713.22	0.19
246	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMY UN	纽约交易所	US	1,138	252,685.75	0.19
247	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	US	924	252,617.95	0.19
248	AES Corp	爱伊斯公司	AES UN	纽约交易所	US	3,386	252,604.59	0.19
249	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	US	815	252,602.14	0.19
250	Peoples United Financial Inc	People's United Financial 公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	3,118	252,453.75	0.19
251	Waters Corp	活德公司	WAT UN	纽约交易所	US	541	252,420.67	0.19
252	CBRE Group, Inc.	世邦魏理仕公司	CBG UN	纽约交易所	US	2,632	252,408.01	0.19
253	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE UN	纽约交易所	US	1,851	252,386.58	0.19
254	Google Inc	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	62	252,324.58	0.19
255	VeriSign Inc	VeriSign 公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	1,121	252,301.39	0.19
256	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	US	728	252,288.04	0.19
257	McDonalds Corp	麦当劳公司	MCD UN	纽约交易所	US	399	252,235.55	0.19
258	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	1,865	252,180.29	0.19
259	Novellus Systems Inc	诺发系统公司	NVLS UQ	纳斯达克交易所	US	969	252,099.07	0.19
260	Monsanto Co.	孟山都公司	MON UN	纽约交易所	US	571	252,098.82	0.19
261	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	US	1,283	252,060.83	0.19
262	Sara Lee Corp	Sara Lee 公司	SLE UN	纽约交易所	US	2,114	252,016.34	0.19
263	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易	US	415	251,995.36	0.19

				所				
264	Western Union Co	西联汇款公司	WU UN	纽约交易所	US	2,190	251,969.21	0.19
265	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	655	251,917.54	0.19
266	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	1,032	251,907.97	0.19
267	AGL Resources	AGL Resources 公司	GAS UN	纽约交易所	US	946	251,897.13	0.19
268	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	US	1,503	251,814.02	0.19
269	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	US	306	251,806.65	0.19
270	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	812	251,774.64	0.19
271	Express Scripts Inc	快捷药方公司	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	894	251,738.98	0.19
272	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	577	251,657.57	0.19
273	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具公司	ITW UN	纽约交易所	US	855	251,639.36	0.19
274	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	US	668	251,529.91	0.19
275	Loews Corp	罗斯公司	L UN	纽约交易所	US	1,060	251,462.62	0.19
276	Federated Investors Inc B	联合投资公司	FII UN	纽约交易所	US	2,634	251,438.04	0.19
277	Lilly, Eli & Co	礼来公司	LLY UN	纽约交易所	US	960	251,390.79	0.19
278	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	US	1,362	251,361.68	0.19
279	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	107	251,353.86	0.19
280	Baxter Intl Inc	百特公司	BAX UN	纽约交易所	US	806	251,285.44	0.19
281	PepsiCo Inc	百事可乐公司	PEP UN	纽约交易所	US	601	251,256.89	0.19
282	Praxair Inc	普莱克斯公司	PX UN	纽约交易所	US	373	251,240.20	0.19
283	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	US	709	251,198.42	0.19
284	Kraft Foods Inc A	卡夫食品公	KFT UN	纽约交易	US	1,067	251,173.53	0.19

285	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	525	251,075.11	0.19
286	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔公司	HON UN	纽约交易所	US	733	251,018.72	0.19
287	Safeway Inc	Safeway 公司	SWY UN	纽约交易所	US	1,893	250,956.78	0.19
288	Procter & Gamble	宝洁公司	PG UN	纽约交易所	US	597	250,938.82	0.19
289	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	678	250,937.88	0.19
290	Archer-Daniels-Midland Co	ADM 公司	ADM UN	纽约交易所	US	1,392	250,846.39	0.19
291	Medco Health Solutions Inc	Medco 保健公司	MHS UN	纽约交易所	US	712	250,780.86	0.19
292	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	885	250,766.05	0.19
293	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	2,871	250,725.79	0.19
294	Darden Restaurants Inc	达登饭店公司	DRI UN	纽约交易所	US	873	250,721.25	0.19
295	Valero Energy Corp	Valero 能源公司	VLO UN	纽约交易所	US	1,890	250,678.16	0.19
296	Moodys Corp	穆迪公司	MCO UN	纽约交易所	US	1,181	250,625.10	0.19
297	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	624	250,610.48	0.19
298	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮公司	YUM UN	纽约交易所	US	674	250,604.06	0.19
299	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	917	250,588.62	0.19
300	Kroger Co	Kroger 公司	KR UN	纽约交易所	US	1,642	250,582.00	0.19
301	Franklin Resources Inc	富兰克林资源公司	BEN UN	纽约交易所	US	414	250,579.48	0.19
302	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油公司	APC UN	纽约交易所	US	521	250,573.75	0.19
303	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化公司	ROK UN	纽约交易所	US	542	250,564.99	0.19
304	Marriott Intl A	万豪国际公司	MAR UN	纽约交易所	US	1,363	250,515.66	0.19
305	Danaher Corp	丹纳赫公司	DHR UN	纽约交易所	US	845	250,453.21	0.19

				所				
306	Devon Energy Corp	戴文能源公司	DVN UN	纽约交易所	US	641	250,410.37	0.19
307	Heinz, H. J. Co	亨氏公司	HNZ UN	纽约交易所	US	735	250,267.97	0.19
308	Unum Group	Unum 公司	UNM UN	纽约交易所	US	1,885	250,252.53	0.19
309	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	1,052	250,095.07	0.19
310	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	978	250,065.33	0.19
311	Legg Mason Inc	Legg Mason 公司	LM UN	纽约交易所	US	1,650	250,035.46	0.19
312	Waste Management Inc	废品管理公司	WM UN	纽约交易所	US	1,213	250,002.26	0.19
313	United Parcel Service Inc B	UPS 公司	UPS UN	纽约交易所	US	542	249,950.28	0.19
314	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	543	249,932.44	0.19
315	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	US	508	249,922.93	0.19
316	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	1,348	249,882.10	0.19
317	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	2,027	249,818.84	0.19
318	Reynolds American Inc	雷诺兹美国公司	RAI UN	纽约交易所	US	957	249,761.00	0.19
319	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	US	1,350	249,742.47	0.19
320	Smucker, J. M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	US	507	249,718.47	0.19
321	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	US	399	249,696.35	0.19
322	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	1,316	249,671.65	0.19
323	SLM Corp	SLM 公司	SLM UQ	纳斯达克交易所	US	2,957	249,665.60	0.19
324	Northern Trust Corp (IL)	北美信托公司	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	999	249,643.80	0.19
325	Altria Group Inc	高特利公司	MO UN	纽约交易所	US	1,336	249,593.77	0.19
326	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	1,286	249,571.09	0.19
327	General Mills	通用磨坊公	GIS UN	纽约交易	US	980	249,526.98	0.19

	Inc	司		所				
328	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	1,003	249,505.81	0.19
329	Apache Corp	阿帕契公司	APA UN	纽约交易所	US	437	249,411.42	0.19
330	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	460	249,379.54	0.19
331	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH UN	纽约交易所	US	519	249,350.24	0.19
332	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	US	1,669	249,339.15	0.19
333	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融公司	CINF UQ	纳斯达克交易所	US	1,299	249,311.11	0.19
334	Xerox Corp	施乐公司	XRX UN	纽约交易所	US	4,970	249,271.17	0.19
335	Lorillard Inc	Lorillard 股份有限公司	LO UN	纽约交易所	US	347	249,251.00	0.19
336	Campbell Soup Co	金宝汤公司	CPB UN	纽约交易所	US	1,190	249,235.88	0.19
337	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢公司	SLB UN	纽约交易所	US	579	249,209.98	0.19
338	Textron Inc	德事隆公司	TXT UN	纽约交易所	US	2,139	249,201.29	0.19
339	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	752	249,185.98	0.19
340	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	US	593	249,145.40	0.19
341	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	US	932	249,108.85	0.19
342	Berkshire Hathaway B	伯克希尔·哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	US	518	249,032.99	0.19
343	Electronic Arts	电子艺界公司	EA UQ	纳斯达克交易所	US	1,918	248,953.60	0.19
344	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	1,347	248,932.87	0.19
345	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料公司	VMC UN	纽约交易所	US	1,004	248,932.18	0.19
346	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	507	248,919.83	0.19
347	Texas	德州仪器公	TXN UN	纽约交易	US	1,357	248,899.85	0.19

	Instruments Inc	司		所				
348	Lowes Cos Inc	劳氏公司	LOW UN	纽约交易所	US	1,556	248,830.61	0.19
349	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	998	248,827.96	0.19
350	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	US	658	248,800.99	0.19
351	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	US	2,128	248,724.25	0.19
352	Diamond Offshore Drilling	钻石近海勘探公司	DO UN	纽约交易所	US	714	248,606.04	0.19
353	Deere & Co	迪尔公司	DE UN	纽约交易所	US	510	248,561.05	0.19
354	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	1,911	248,526.65	0.19
355	Whirlpool Corp	惠而浦公司	WHR UN	纽约交易所	US	831	248,450.47	0.19
356	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	US	506	248,396.98	0.19
357	Jabil Circuit Inc	捷普科技公司	JBL UN	纽约交易所	US	2,005	248,370.77	0.19
358	Johnson & Johnson	强生公司	JNJ UN	纽约交易所	US	601	248,341.03	0.19
359	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	US	371	248,069.71	0.19
360	Rowan Companies Inc	Rowan 公司	RDC UN	纽约交易所	US	1,298	248,055.97	0.19
361	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	US	961	248,019.55	0.19
362	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	828	247,970.91	0.19
363	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公司	DNR UN	纽约交易所	US	2,606	247,944.20	0.19
364	QEP Resources	QEP Resources 公司	QEP UN	纽约交易所	US	1,343	247,939.78	0.19
365	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	1,990	247,891.90	0.19
366	Windstream Corp	Windstream 公司	WIN UQ	纳斯达克交易所	US	3,350	247,808.10	0.19
367	Lexmark International Inc	利盟国际公司	LXK UN	纽约交易所	US	1,189	247,752.84	0.19

368	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	US	688	247,746.35	0.19
369	Priceline.com Inc	Priceline.com 股份有限公司	PCLN UQ	纳斯达克交易所	US	84	247,547.49	0.19
370	Lincoln National Corp	林肯国民公司	LNC UN	纽约交易所	US	2,022	247,418.95	0.19
371	Symantec Corp	赛门铁克公司	SYMC UQ	纳斯达克交易所	US	2,509	247,410.19	0.19
372	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄公司	CL UN	纽约交易所	US	425	247,409.56	0.19
373	Rockwell Collins	洛克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	US	709	247,356.51	0.19
374	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	1,274	247,322.55	0.19
375	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	1,680	247,277.56	0.19
376	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	2,170	247,206.99	0.19
377	Goodrich Corp	古德里奇公司	GR UN	纽约交易所	US	317	247,076.56	0.19
378	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	US	2,115	247,071.52	0.19
379	EOG Resources	EOG 资源公司	EOG UN	纽约交易所	US	398	247,039.26	0.19
380	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	1,490	247,007.25	0.19
381	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	US	1,068	246,967.56	0.19
382	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	US	2,590	246,911.48	0.19
383	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	US	972	246,877.58	0.19
384	Linear Technology Corp	凌特公司	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	1,304	246,737.70	0.19
385	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	US	747	246,729.00	0.19
386	Centerpoint Energy Inc	中点能源公司	CNP UN	纽约交易所	US	1,948	246,587.74	0.19
387	Kohls Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约交易所	US	793	246,582.89	0.19
388	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	714	246,491.59	0.19
389	Coca-Cola Co	可口可乐公司	KO UN	纽约交易所	US	559	246,448.55	0.19

		司		所				
390	Titanium Metals Corp	钛金属公司	TIE UN	纽约交易所	US	2,611	246,445.72	0.19
391	Whole Foods Market Inc	全食超市公司	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	562	246,390.14	0.19
392	Peabody Energy Corp	博地能源公司	BTU UN	纽约交易所	US	1,181	246,383.53	0.19
393	Best Buy Co Inc	百思买公司	BBY UN	纽约交易所	US	1,673	246,352.65	0.19
394	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	1,117	246,263.30	0.19
395	Cummins Inc	康明斯公司	CMI UN	纽约交易所	US	444	246,244.72	0.19
396	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	1,282	246,209.94	0.19
397	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	470	246,123.87	0.19
398	Adobe Systems Inc	奥多比公司	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	1,381	245,992.62	0.19
399	Motorola Mobility Holdings, Inc	Motorola Mobility Holding 公司	MMI UN	纽约交易所	US	1,006	245,941.77	0.19
400	DIRECTV Class A	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	912	245,716.95	0.19
401	Chicago Mercantile Exchange	芝加哥商业交易所控股公司	CME UQ	纳斯达克交易所	US	160	245,654.45	0.18
402	Intl Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约交易所	US	212	245,625.21	0.18
403	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	487	245,329.64	0.18
404	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UN	纽约交易所	US	1,258	245,326.17	0.18
405	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	769	245,273.75	0.18
406	Watson Pharmaceuticals	华生制药	WPI UN	纽约交易所	US	645	245,226.62	0.18
407	Limited Brands Inc	Limited Brands 公司	LTD UN	纽约交易所	US	964	245,088.63	0.18
408	Goldman Sachs Group Inc	高盛公司	GS UN	纽约交易所	US	430	245,009.87	0.18

409	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	96	244,978.99	0.18
410	FirstEnergy Corp	第一能源公司	FE UN	纽约交易所	US	877	244,796.90	0.18
411	Biogen Idec Inc	生物基因公司	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	353	244,775.16	0.18
412	Hewlett-Packard Co	惠普公司	HPQ UN	纽约交易所	US	1,507	244,602.95	0.18
413	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	1,505	244,467.99	0.18
414	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	US	774	244,430.06	0.18
415	Motorola Solutions, Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约交易所	US	838	244,418.34	0.18
416	Unitedhealth Group Inc	联合健康公司	UNH UN	纽约交易所	US	765	244,287.15	0.18
417	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	US	1,166	244,282.74	0.18
418	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店公司	FDO UN	纽约交易所	US	672	244,144.25	0.18
419	Target Corp	Target 百货公司	TGT UN	纽约交易所	US	756	243,985.47	0.18
420	eBay Inc.	电子湾公司	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	1,276	243,851.63	0.18
421	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOY UN	纽约交易所	US	516	243,747.29	0.18
422	DuPont, E. I. de Nemours	杜邦公司	DD UN	纽约交易所	US	845	243,744.65	0.18
423	Mattel Inc	美泰公司	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	1,393	243,653.79	0.18
424	NetFlix Inc	Netflix 公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	558	243,616.86	0.18
425	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	388	243,497.02	0.18
426	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	1,601	243,417.19	0.18
427	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	1,540	243,263.89	0.18
428	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	607	243,132.77	0.18
429	PG&E Corporation	太平洋煤气电力公司	PCG UN	纽约交易所	US	936	243,100.82	0.18
430	AutoNation Inc	AutoNation	AN UN	纽约交易	US	1,046	243,000.64	0.18

		公司		所				
431	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	US	2,128	242,958.67	0.18
432	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克墨伦	FCX UN	纽约交易所	US	1,048	242,937.00	0.18
433	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰公司	IR UN	纽约交易所	US	1,265	242,865.36	0.18
434	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UQ	纳斯达克交易所	US	396	242,778.72	0.18
435	United Technologies Corp	联合技术公司	UTX UN	纽约交易所	US	527	242,700.78	0.18
436	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	1,660	242,660.26	0.18
437	BMC Software Inc	BMC 软件公司	BMC UQ	纳斯达克交易所	US	1,174	242,482.07	0.18
438	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	US	674	242,195.38	0.18
439	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	915	242,143.59	0.18
440	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	US	1,601	242,105.78	0.18
441	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇公司	SIAL UQ	纳斯达克交易所	US	615	242,035.84	0.18
442	Costco Wholesale Corp	好市多批发公司	COST UQ	纳斯达克交易所	US	461	242,020.85	0.18
443	Dell Inc	戴尔公司	DELL UQ	纳斯达克交易所	US	2,622	241,701.64	0.18
444	Bemis Co Inc	Bemis 公司	BMS UN	纽约交易所	US	1,275	241,652.12	0.18
445	Intercontinental Exchange	洲际交易所公司 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	US	318	241,544.37	0.18
446	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	1,023	241,524.90	0.18
447	Sealed Air Corp	希悦尔包装公司	SEE UN	纽约交易所	US	2,227	241,492.52	0.18
448	Noble Corp	Noble 公司	NE UN	纽约交易所	US	1,267	241,253.52	0.18
449	Alcoa Inc	美铝公司	AA UN	纽约交易所	US	4,423	241,065.82	0.18
450	FedEx Corp	联邦快递公司	FDX UN	纽约交易所	US	458	240,994.18	0.18
451	Coventry Health Care Inc	Coventry Health	CVH UN	纽约交易所	US	1,259	240,920.14	0.18

		Care 公司						
452	NetApp Inc	网域存储技术公司	NTAP UQ	纳斯达克交易所	US	1,054	240,874.46	0.18
453	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	301	240,845.54	0.18
454	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	US	903	240,617.95	0.18
455	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	1,812	240,446.88	0.18
456	WellPoint Inc	WellPoint 公司	WLP UN	纽约交易所	US	576	240,442.34	0.18
457	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	US	573	240,309.27	0.18
458	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	1,469	240,286.33	0.18
459	Life Technologies Corp	Life 科技公司	LIFE UQ	纳斯达克交易所	US	980	240,264.66	0.18
460	Southwest Airlines Co	西南航空公司	LUV UN	纽约交易所	US	4,443	239,636.33	0.18
461	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	US	614	239,630.54	0.18
462	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	US	117	239,569.61	0.18
463	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	591	239,479.63	0.18
464	United States Steel Corp	美国钢铁公司	X UN	纽约交易所	US	1,436	239,412.52	0.18
465	CA Inc	冠群国际公司	CA UQ	纳斯达克交易所	US	1,875	238,823.83	0.18
466	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK UQ	纳斯达克交易所	US	1,248	238,500.66	0.18
467	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	US	1,158	238,155.87	0.18
468	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	US	606	238,073.84	0.18
469	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	US	1,695	238,057.77	0.18
470	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	US	1,751	237,648.15	0.18
471	AmerisourceBergen Corp	美源伯根公司	ABC UN	纽约交易所	US	1,014	237,611.10	0.18
472	Accenture plc	Accenture 公司	ACN UN	纽约交易所	US	708	237,461.01	0.18

473	SAIC Inc	SAIC 公司	SAI UN	纽约交易所	US	3,066	237,425.10	0.18
474	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	US	1,536	237,212.25	0.18
475	Walgreen Co	沃尔格林公司	WAG UN	纽约交易所	US	1,136	236,637.61	0.18
476	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath&Beyond 公司	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	647	236,325.27	0.18
477	American Express Co	美国运通公司	AXP UN	纽约交易所	US	795	236,284.70	0.18
478	Donnelley, R. R. & Sons	R. R. 当纳利父子	RRD UQ	纳斯达克交易所	US	2,597	236,124.40	0.18
479	Kimco Realty Corp	Kimco Realty 公司	KIM UN	纽约交易所	US	2,303	235,658.20	0.18
480	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业公司	NEM UN	纽约交易所	US	623	235,566.90	0.18
481	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	US	270	234,907.63	0.18
482	Staples Inc	Staples 公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	2,684	234,902.34	0.18
483	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	2,859	233,825.26	0.18
484	Bard, C. R. Inc	CR 巴德公司	BCR UN	纽约交易所	US	434	233,807.50	0.18
485	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	214	233,406.76	0.18
486	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	1,158	233,048.36	0.18
487	Emerson Electric Co	艾默生电气公司	EMR UN	纽约交易所	US	792	232,498.67	0.18
488	Citrix Systems Inc	思杰系统公司	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	607	232,232.52	0.17
489	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	US	758	231,687.75	0.17
490	Salesforce.com	Salesforce .com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	US	362	231,422.73	0.17
491	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所集团	NYX UN	纽约交易所	US	1,406	231,221.61	0.17

492	Cardinal Health Inc	Cardinal Health	CAH UN	纽约交易所	US	900	230,291.59	0.17
493	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	US	523	226,490.83	0.17
494	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	US	1,496	223,399.67	0.17
495	Hasbro Inc	孩之宝公司	HAS UQ	纳斯达克交易所	US	1,106	222,234.89	0.17
496	Oracle Corp	甲骨文公司	ORCL UQ	纳斯达克交易所	US	1,363	220,285.45	0.17
497	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	817	212,554.12	0.16
498	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	1,298	206,181.70	0.16
499	Sears Holdings Corp	西尔斯控股	SHLD UQ	纳斯达克交易所	US	844	169,004.76	0.13

8.4.1 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

无。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	AGL Resources	GAS UN	591,506.53	0.45
2	NetFlix Inc	NFLX UQ	583,666.34	0.44
3	National Semiconductor	NSM UN	568,202.97	0.43
4	First Solar Inc	FSLR UQ	553,757.49	0.42
5	Expedia	EXPE UQ	547,409.34	0.41
6	Alpha Natural Resources	ANR UN	547,375.86	0.41
7	Abercrombie & Fitch Company A	ANF UN	525,532.67	0.40
8	Hospira, Inc	HSP UN	496,522.12	0.37
9	Metropcs Communications Inc	PCS UN	496,267.73	0.37
10	Dean Foods Co	DF UN	479,575.72	0.36
11	Wynn Resorts Ltd	WYNN UQ	477,429.15	0.36
12	Limited Brands	LTD UN	474,229.66	0.36

	Inc			
13	E*TRADE Financial Corp	ETFC UQ	473,199.37	0.36
14	Hartford Finl Services Group	HIG UN	471,376.17	0.35
15	Citrix Systems Inc	CTXS UQ	464,685.69	0.35
16	Cephalon Inc	CEPH UQ	462,179.32	0.35
17	BMC Software Inc	BMC UQ	458,485.76	0.35
18	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	456,527.14	0.34
19	Bank of America Corp	BAC UN	455,777.47	0.34
20	Avon Products	AVP UN	450,987.72	0.34

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。

8.5.2 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	570,803.55	0.43
2	Cephalon Inc	CEPH UQ	461,953.68	0.35
3	RadioShack Corp	RSH UN	310,399.77	0.23
4	-	BMO UN	308,633.84	0.23
5	Tellabs Inc	TLAB UQ	292,381.68	0.22
6	Compuware Corp	CPWR UQ	259,860.43	0.20
7	AK Steel Hldg Corp	AKS UN	259,646.56	0.20
8	Biogen Idec Inc	BIIB UQ	240,309.76	0.18
9	Monster Worldwide Inc	MWW UN	231,288.94	0.17
10	Cabot Oil & Gas A	COG UN	223,549.32	0.17
11	Janus Capital Group Inc	JNS UN	221,366.38	0.17
12	Goodrich Corp	GR UN	211,104.66	0.16
13	OReilly Automotive	ORLY UQ	206,971.62	0.16
14	Mastercard Inc A	MA UN	201,713.97	0.15
15	Motorola Mobility Holdings, Inc	MMI UN	201,240.74	0.15
16	Intuitive Surgical Inc	ISRG UQ	194,238.52	0.15

17	El Paso Corp	EP UN	193,635.17	0.15
18	Limited Brands Inc	LTD UN	190,243.12	0.14
19	Amazon.com Inc	AMZN UQ	190,223.84	0.14
20	Expedia	EXPE UQ	188,941.52	0.14

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	189,389,965.46
卖出收入（成交）总额	43,516,376.30

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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	363,326.40
3	应收股利	191,040.70
4	应收利息	746.12
5	应收申购款	156,946.28

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	712,059.50

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 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。

8.11.5.2 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的股票及存托凭证。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
8,409.00	17,892.18	1,763,009.09	1.17%	148,692,300.91	98.83%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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%

§ 10 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
本报告期期初基金份额总额	822,754,222.26
本报告期基金总申购份额	18,385,817.26
减：本报告期基金总赎回份额	690,684,729.52
本报告期末基金份额总额	150,455,310.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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，本年度支付的审计费用为7.2万元整。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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	74,332,999.39	31.92%	22,474.77	27.72%	-
摩根士丹利	-	72,727,038.97	31.23%	23,058.53	28.44%	-
美林证券	-	48,253,162.77	20.72%	24,185.51	29.83%	-
野村证券	-	37,593,140.63	16.14%	11,359.00	14.01%	-
合计		232,906,341.76	100.00%	81,077.81	100.00%	

注：1、根据中国证监会颁布的《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，本公司制定了租用境内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、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商, 具体选择标准如下:

- (一) 具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件;
- (二) 资历雄厚, 信誉良好;
- (三) 财务状况良好, 经营行为规范;
- (四) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度), 能满足各投资组合运作高度保密的要求;
- (五) 证券研究或市场研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务, 并能根据各投资组合投资的特定要求, 提供专题研究报告;
- (六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。
- (七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。
- (八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。
- (九) 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。

交易管理部在每季初5个工作日内, 汇总上季度境外券商综合服务评价结果, 作为本季度境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划, 报部门及公司分管领导批准;

交易量分配计划获批后, 作为选择交易券商的依据, 交交易员在交易时进行券商选择。

公司通过一家境外券商买卖证券的年交易佣金, 不得超过公司当年所有境外投资组合通过境外券商买卖证券交易佣金的30%。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时, 及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作, 并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、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, 天源证券。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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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托管协议	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-2-16
2	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	2011-2-16

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	2011-2-16
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-2-16
5	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	2011-2-16
6	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	2011-2-17
7	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	2011-2-23
8	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	2011-3-24
9	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	2011-4-22
10	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	2011-4-22
11	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	2011-4-26
12	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	2011-5-14
13	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	2011-5-18
14	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	2011-5-24
15	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	2011-5-26
16	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	2011-6-30
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年第 2 季度报告 2011 年 6 月 30 日	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-7-19
18	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年半年度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-8-27
19	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-8-27
20	大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2011-8-29
21	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境	中国证监会指定报刊及	2011-9-2

	外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	本公司网站	
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011-10-26
23	大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书 (2011 年第 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011-11-5
24	大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书摘要 (2011 年第 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2011-11-5
25	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	2011-11-22
26	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	2011-12-21
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 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	2011-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2012年3月28日