

大成标普 500 等权重指数证券投资基金  
2012 年年度报告  
2012 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：2013 年 3 月 26 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 2013 年 3 月 25 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 2012 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 净值表现.....	6
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.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§ 6 审计报告.....	12
§ 7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
7.4 报表附注.....	17
§ 8 投资组合报告.....	31
8.1 期末基金资产组合情况.....	31
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
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.....	33
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	64
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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.....	65

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 .....	65
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 .....	65
8.11 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 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	97,408,937.82 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
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	2012年	2011年3月23日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	79,108.71	-1,161,876.30
本期利润	17,108,874.66	-18,182,616.98
加权平均基金份额本期利润	0.1341	-0.0749
本期加权平均净值利润率	13.97%	-7.89%
本期基金份额净值增长率	13.82%	-11.70%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-1,576,241.73	-17,660,692.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0162	-0.1174

期末基金资产净值	97,933,873.07	132,794,617.01
期末基金份额净值	1.005	0.883
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	0.50%	-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）。

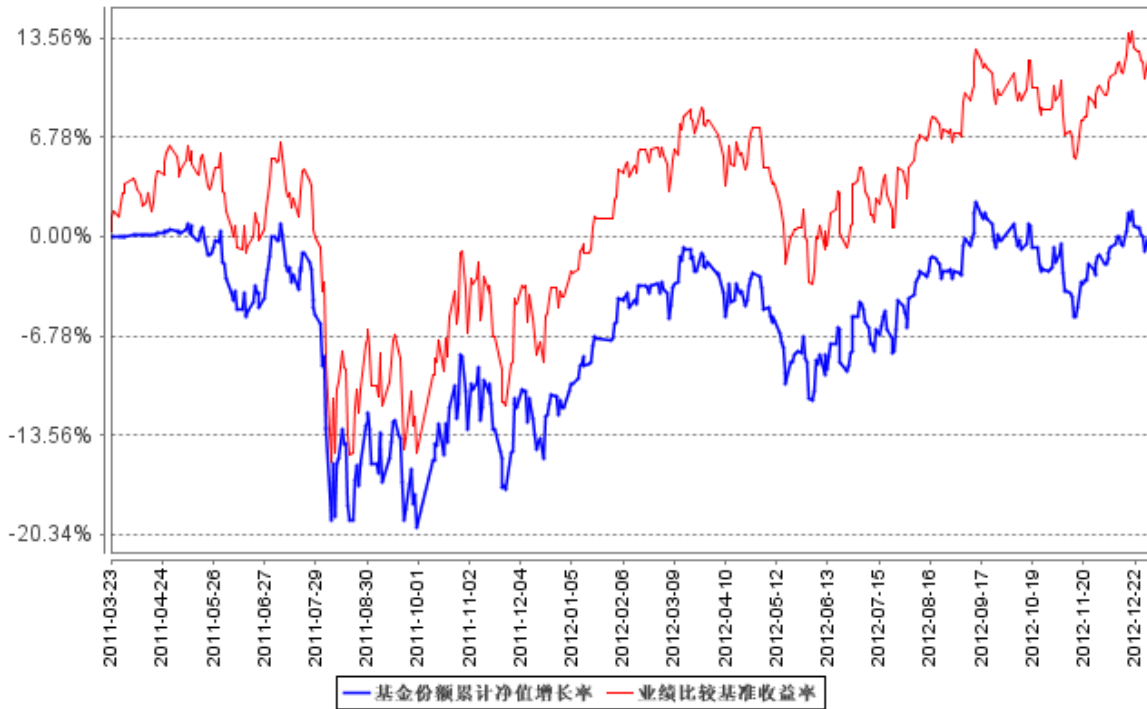
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	0.80%	0.75%	2.82%	0.79%	-2.02%	-0.04%
过去六个月	6.24%	0.76%	8.86%	0.81%	-2.62%	-0.05%
过去一年	13.82%	0.82%	17.65%	0.89%	-3.83%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.50%	1.26%	12.78%	1.36%	-12.28%	-0.10%

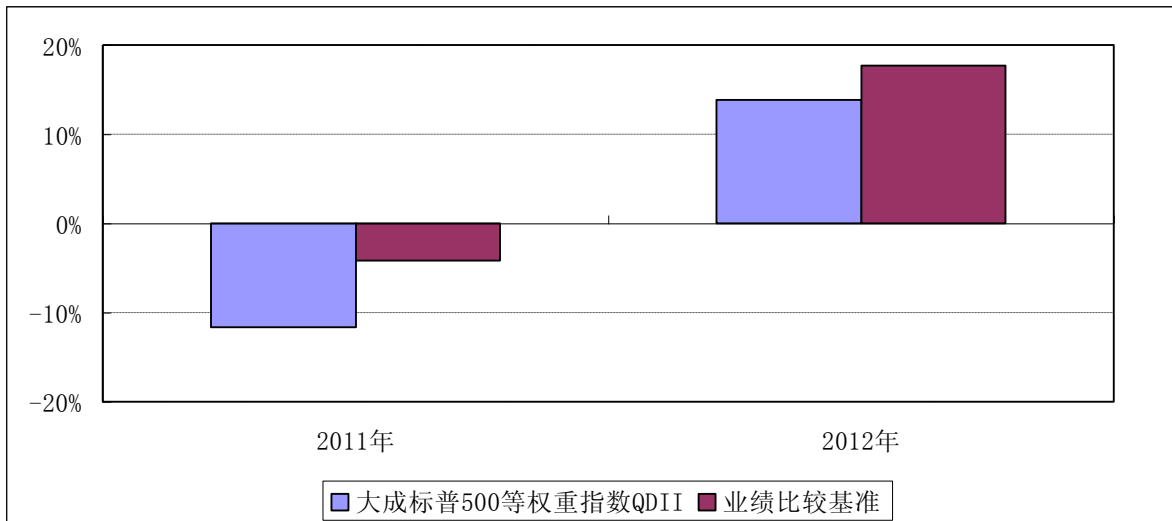
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、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。

2、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 2012 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金及景福证券投资基金，2 只 ETF 及 2 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF、大成深证成长 40ETF 联接基金、中证 500 沪市 ETF 及大成中证 500 沪市 ETF 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 25 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、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成现金增利货币市场基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成理财 21 天债券型发起式基金。

#### 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		
冉凌浩先生	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	9 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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，资产管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。资产管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

##### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差分析及相应交易情形的分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但参与交易所公开竞价同日同向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 10%。结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

##### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

2012 年基金管理人旗下主动投资组合间股票交易存在 6 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 5%。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情况有 9 次，原因是指数型投资组合投资策略需要。投资组合间债券交易存在 4 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要，且参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该股当日成交量 5%。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类

交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 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

2012 年度，国际金融形势和国际宏观经济状况都呈现逐步改善的局势，因此主要国际股票市场指数也有较大幅度的上涨。

从欧洲方面来看，欧洲各国政府及欧洲央行高度重视欧债危机带来的严重后果，采取了各类措施来尽量控制与缓解欧债危机的恶化程度，因此 2012 年欧洲主权债务危机有所缓解。具体来看，一方面，希腊、西班牙及意大利等多个陷入财政困境的国家均采取了程度各异的财政紧缩政策以恢复市场信心；另一方面，以欧洲央行为主导的众多国际金融组织采取了多项救助政策，尤其是欧洲央行的 LTRO 政策卓有成效，同时欧洲央行也将利率下调至历史低位。上述这些措施使得欧洲金融系统的紧张局面暂时得到缓解，意大利、西班牙等国的政府债券收益率水平出现显著下降，欧洲主权债务危机有所缓解。然而，尽管欧洲金融系统暂时得以稳定，但欧洲宏观经济仍然呈现小幅衰退的局势。

在 2012 年，美国的宏观经济及金融体系的状况显著好于欧洲。由于在 2007 年美国金融危机过后，美国的金融机构、工商企业及居民部门快速的调整各自的资产负债表，及至 2012 年美国各经济主体的资产负债表已经较为健康。因此，美国宏观经济在 2012 年逐步走强。

本年度美国经济复苏的显著特征是全面性及持续性，劳动力市场逐步改善、房地产市场显著回暖、制造业恢复增长、个人收入及消费支出也持续增长。虽然在 4 季度，美国曾经面临过财政悬崖的问题，但最后依然得到了解决。在上述多重因素的推动下，美国 2012 年的宏观经济都有较好的表现，而标普指数成分股的盈利也持续增长。

受到美国宏观经济及企业盈利持续增长的推动，在本报告期内，本基金的目标指数上涨 17.65%，美元兑人民币中间价下跌 0.24%，本基金净值上涨 13.82%，低于经汇率调整后的目标指数 3.55%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 1.10%，日均偏差绝对值为 0.055%，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 1.005 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.82% 同期业绩比较基准收益率为 17.65%，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 2013 年，全球宏观经济有望保持持续增长。从欧洲来看，欧元区重新爆发较大金融风险的可能性相对较小，或许某些国家的政治经济局势还会发生一定的变动并有可能会给欧洲金融市场造成一定的波动，但是综合来看，欧洲的金融局势正在逐渐变好。

展望 2013 年，美国宏观经济有望继续保持增长。主要经济增长点依然大概在以下几个方面：（1）美国居民收入及消费支出继续增加；（2）美国房地产市场持续复苏；（3）美国制造业活动稳步扩张。由于核心通胀率仍保持较低的水平，美联储的量化宽松政策仍会保持，这也有望对实体经济及金融市场都产生一定程度的正面影响。但是，美国经济也面临一定的风险。首先，美国政府需要逐步减少财政支出，这会对经济造成小幅的负面影响。其次，美国政府还要面对重新核定债务上限的任务，其过程如果比较曲折，则将会给资本市场带来波动。当然，即使有这些不利因素存在，考虑到强劲的私人经济的增长，美国宏观经济仍然有望保持稳定的增长。而美国宏观经济的的增长有望推动企业盈利的持续增加。

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、制度执行及遵规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，深圳辖区基金公司按照监管部门要求，深入开展内控专项治理活动，公司以此为契机在强化将风险控制放在各项工作之首的风控理念基础上，力求将风控意识深入到每个业务条线。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，并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，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 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞、刘颖
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	2013 年 3 月 25 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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,454,928.95	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	92,182,351.63	125,728,789.60
其中：股票投资		92,182,351.63	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	295.32	746.12
应收股利		103,766.75	191,040.70
应收申购款		58,859.69	156,946.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		100,800,202.34	134,647,263.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		1,405,774.08	-
应付赎回款		1,181,414.49	1,485,945.78
应付管理人报酬		83,679.53	113,815.16
应付托管费		20,919.88	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	174,541.29	224,431.88
负债合计		2,866,329.27	1,852,646.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	97,408,937.82	150,455,310.00
未分配利润	7.4.7.10	524,935.25	-17,660,692.99
所有者权益合计		97,933,873.07	132,794,617.01
负债和所有者权益总计		100,800,202.34	134,647,263.61

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.005元，基金份额总额97,408,937.82份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成标普500等权重指数证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年3月23日(基 金合同生效日)至2011 年12月31日
<b>一、收入</b>		19,324,840.40	-15,583,925.99
1. 利息收入		22,478.56	2,356,005.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,478.56	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）		2,578,876.50	-1,428,430.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	344,684.84	-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		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,234,191.66	1,623,084.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	17,029,765.95	-17,020,740.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-390,097.17	-350,624.56
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	83,816.56	859,863.79
<b>减：二、费用</b>		2,215,965.74	2,598,690.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,227,941.12	1,795,790.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	306,985.23	448,947.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	28,959.07	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	652,080.32	272,875.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,108,874.66	-18,182,616.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,108,874.66	-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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	150,455,310.00	-17,660,692.99	132,794,617.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		17,108,874.66	17,108,874.66
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)	-53,046,372.18	1,076,753.58	-51,969,618.60
其中：1. 基金申购款	39,428,510.24	-1,242,486.30	38,186,023.94
2. 基金赎回款	-92,474,882.42	2,319,239.88	-90,155,642.54
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)	97,408,937.82	524,935.25	97,933,873.07
项目	上年度可比期间 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 2013 年 3 月 25 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度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。比较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。

本基金目前以交易目的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，包括银行存款和其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

#### 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，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的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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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为正数，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，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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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，不需要披露分部信息。

#### 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[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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	8,454,928.95	8,206,414.51
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	8,454,928.95	8,206,414.51

注：于 2012 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,128,237.08 元，折合人民币 7,091,534.17 元(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 2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,173,326.36	92,182,351.63	9,025.27
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	92,173,326.36	92,182,351.63	9,025.27
项目	上年度末 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

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	295.32	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	295.32	746.12

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011年12月31日
应付赎回费	2,541.29	5,600.24
预提信息披露费	100,000.00	75,000.00
预提审计费	72,000.00	72,000.00
预提指数使用费	-	71,831.64
合计	174,541.29	224,431.88

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	150,455,310.00	150,455,310.00
本期申购	39,428,510.24	39,428,510.24
本期赎回(以“-”号填列)	-92,474,882.42	-92,474,882.42
本期末	97,408,937.82	97,408,937.82

#### 7.4.7.10 未分配利润

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	-2,409,977.36	-15,250,715.63	-17,660,692.99
本期利润	79,108.71	17,029,765.95	17,108,874.66
本期基金份额交易产生的变动数	754,626.92	322,126.66	1,076,753.58
其中：基金申购款	-637,065.70	-605,420.60	-1,242,486.30
基金赎回款	1,391,692.62	927,547.26	2,319,239.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,576,241.73	2,101,176.98	524,935.25

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 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	22,377.78	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	100.78	44.76
合计	22,478.56	2,356,005.74

**7.4.7.12 股票投资收益**
**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 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	69,266,317.05	43,516,376.30
减：卖出股票成本总额	68,921,632.21	46,567,891.37
买卖股票差价收入	344,684.84	-3,051,515.07

**7.4.7.13 债券投资收益**

本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本报告期内及上年度可比期间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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 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	2,234,191.66	1,623,084.79
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,234,191.66	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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年3月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日



1. 交易性金融资产	17,029,765.95	-17,020,740.68
——股票投资	17,029,765.95	-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	17,029,765.95	-17,020,740.68

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年 12月31日	上年度可比期间 2011年3月23日(基金合 同生效日)至2011年12月31日
基金赎回费收入	83,816.56	859,740.61
其他	-	123.18
合计	83,816.56	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 2012年1月1日 至2012年12月31日	上年度可比期间 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	28,959.07	81,077.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	28,959.07	81,077.81

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012 年12月31日	上年度可比期间 2011年3月23日(基金合 同生效日)至2011年12月31 日
信息披露费	300,000.00	75,000.00
指数使用费	259,257.68	111,909.48
审计费用	72,000.00	72,000.00
其他	14,660.09	900.00
银行划款手续费	6,162.55	13,065.98
合计	652,080.32	272,875.46

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年8,000美元收取，按年支付；标的指数许可使用费按前一日基金资产净值

的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00 美元。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 12 月 31 日	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	1,227,941.12	1,795,790.15
其中：支付销售机构的客户维护费	517,003.24	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 × 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	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	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	306,985.23	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本报告期内及上年度可比期间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

本报告期内及上年度可比期间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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		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	期末余额	当期利息收入
中银香港	7,091,534.17	-	4,819,234.42	-
中国银行	1,363,394.78	22,377.78	3,387,180.09	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

本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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事项。

#### 7.4.12 期末(2012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2012年12月31日，本基金未持有信用类债券(2011年12月31日：同)。

##### 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发行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。

于2012年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

本基金持有及承担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

单位：人民币元

本期末 2012年12月31日	1年以内	1年至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	8,454,928.95	-	-	-	8,454,928.95
交易性金融资产	-	-	-	92,182,351.63	92,182,351.63
应收利息	-	-	-	295.32	295.32
应收股利	-	-	-	103,766.75	103,766.75
应收申购款	21,706.42	-	-	37,153.27	58,859.69
<b>资产总计</b>	<b>8,476,635.37</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>92,323,566.97</b>	<b>100,800,202.34</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	1,405,774.08	1,405,774.08
应付赎回款	-	-	-	1,181,414.49	1,181,414.49
应付管理人报酬	-	-	-	83,679.53	83,679.53
应付托管费	-	-	-	20,919.88	20,919.88
其他负债	-	-	-	174,541.29	174,541.29
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,866,329.27</b>	<b>2,866,329.27</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>8,476,635.37</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>89,457,237.70</b>	<b>97,933,873.07</b>
<b>上年度末 2011年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1年至5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
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
<b>资产总计</b>	<b>8,270,290.17</b>	-	-	<b>126,376,973.44</b>	<b>134,647,263.61</b>
<b>负债</b>					
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
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,852,646.60</b>	<b>1,852,646.60</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>8,270,290.17</b>	-	-	<b>124,524,326.84</b>	<b>132,794,617.01</b>

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012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 2012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	7,091,534.17	-	-	7,091,534.17
交易性金融资产	92,182,351.63	-	-	92,182,351.63
应收股利	103,766.75	-	-	103,766.75
资产合计	99,377,652.55	-	-	99,377,652.55
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,405,774.08	-	-	1,405,774.08
负债合计	1,405,774.08	-	-	1,405,774.08
资产负债表外汇风险敞口净额	97,971,878.47	-	-	97,971,878.47
项目	上年度末 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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 490	增加约 656
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 490	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 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	92,182,351.63	94.13	125,728,789.60	94.68
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	92,182,351.63	94.13	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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	增加约461	增加约614
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	减少约461	减少约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) 各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为92,182,351.63元,无属于第二层级和第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级125,728,789.60元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间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) 第三层级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	92,182,351.63	91.45
	其中:普通股票	92,182,351.63	91.45
	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	8,454,928.95	8.39
8	其他各项资产	162,921.76	0.16
9	合计	100,800,202.34	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	92,182,351.63	94.13
合计	92,182,351.63	94.13

## 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	占基金资产净值比例(%)
金融	15,141,144.93	15.46
消费者非必需品	15,127,333.36	15.45
信息技术	12,858,780.44	13.13
工业	11,215,616.37	11.45
医疗保健	9,556,713.47	9.76
能源	7,831,663.39	8.00
消费者常用品	7,640,770.60	7.80
基础材料	5,689,108.00	5.81
公用事业	5,678,197.24	5.80
电信服务	1,443,023.83	1.47
合计	92,182,351.63	94.13

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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 例(%)
1	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所 集团	NYX UN	纽约交 易所	US	1,235	244,832.17	0.25
2	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交 易所	US	2,632	214,237.50	0.22
3	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,493	209,362.65	0.21
4	MeadWestv aco Corp	MeadWestvaco 公司	MWV UN	纽约交 易所	US	1,021	204,525.58	0.21
5	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	843	204,316.97	0.21
6	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气 公司	COG UN	纽约交 易所	US	653	204,154.42	0.21
7	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交 易所	US	1,839	202,398.69	0.21
8	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达 克交易 所	US	2,329	202,163.62	0.21
9	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达 克交易 所	US	640	201,779.64	0.21
10	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交 易所	US	2,761	201,309.48	0.21
11	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业 公司	PCL UN	纽约交 易所	US	720	200,799.10	0.21
12	Monsanto Co.	孟山都公司	MON UN	纽约交 易所	US	336	199,893.99	0.20
13	Expedito rs 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	803	199,618.99	0.20
14	Jabil Circuit Inc	捷普科技	JBL UN	纽约交 易所	US	1,645	199,451.80	0.20
15	State Street	道富集团	STT UN	纽约交 易所	US	675	199,449.91	0.20

	Corp							
16	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	898	199,246.58	0.20
17	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	US	555	199,155.75	0.20
18	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	US	896	199,084.41	0.20
19	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	US	677	198,679.19	0.20
20	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	1,486	198,667.18	0.20
21	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	US	1,897	198,647.07	0.20
22	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	1,474	198,267.30	0.20
23	Johnson Controls Inc	江森自控公司	JCI UN	纽约交易所	US	1,027	198,174.90	0.20
24	Genworth Financial Inc	Genworth 金融公司	GNW UN	纽约交易所	US	4,198	198,162.83	0.20
25	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	696	197,780.55	0.20
26	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	1,032	197,712.67	0.20
27	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	US	309	197,601.41	0.20
28	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	537	197,523.35	0.20
29	Health Care REIT Inc	医疗保健 REIT	HCN UN	纽约交易所	US	512	197,242.01	0.20
30	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇	SIAL UQ	纳斯达克交易所	US	426	197,019.50	0.20

31	Carmax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	833	196,552.74	0.20
32	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	US	640	196,469.64	0.20
33	WellPoint Inc	WellPoint 公司	WLP UN	纽约交易所	US	513	196,434.19	0.20
34	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交易所	US	982	196,404.53	0.20
35	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	US	381	196,395.54	0.20
36	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	US	244	195,633.92	0.20
37	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	316	195,582.89	0.20
38	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	760	195,426.25	0.20
39	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	US	602	195,247.74	0.20
40	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	800	195,202.49	0.20
41	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	3,469	195,149.38	0.20
42	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	US	1,147	195,088.22	0.20
43	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	448	195,057.67	0.20
44	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	730	194,961.75	0.20
45	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOY UN	纽约交易所	US	486	194,832.15	0.20
46	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	US	5,408	194,774.07	0.20
47	Ball Corp	波尔公司	BLL UN	纽约交	US	692	194,643.08	0.20

				易所				
48	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	1,704	194,502.53	0.20
49	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	1,578	194,502.16	0.20
50	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	US	953	194,497.95	0.20
51	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	US	1,618	194,449.23	0.20
52	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	US	1,644	194,370.54	0.20
53	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻探公司	DO UN	纽约交易所	US	455	194,358.97	0.20
54	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	726	194,258.53	0.20
55	Agilent Technologies Inc	安捷伦公司	A UN	纽约交易所	US	754	194,025.59	0.20
56	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	US	946	193,782.84	0.20
57	Allergan Inc	爱力根	AGN UN	纽约交易所	US	336	193,727.16	0.20
58	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	US	595	193,725.40	0.20
59	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	US	596	193,563.98	0.20
60	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	US	642	193,532.56	0.20
61	Hartford Financial Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	US	1,372	193,515.96	0.20
62	Principal Financial Group	信安金融	PFJ UN	纽约交易所	US	1,079	193,424.19	0.20
63	Grainger	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交	US	152	193,343.49	0.20

	W. W. Inc			易所				
64	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	777	193,204.45	0.20
65	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	US	720	193,150.90	0.20
66	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	US	1,047	193,018.34	0.20
67	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	3,775	192,906.71	0.20
68	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	US	451	192,905.45	0.20
69	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	US	254	192,843.29	0.20
70	Dean Foods Co	Dean 食品公司	DF UN	纽约交易所	US	1,858	192,811.36	0.20
71	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	US	806	192,765.60	0.20
72	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	474	192,762.46	0.20
73	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	US	868	192,753.91	0.20
74	Waters Corp	活德公司	WAT UN	纽约交易所	US	352	192,752.65	0.20
75	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	US	437	192,548.12	0.20
76	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约交易所	US	1,009	192,545.23	0.20
77	McGraw-Hill Cos Inc	麦格希	MHP UN	纽约交易所	US	560	192,431.84	0.20
78	Public Storage	Public Storage 公司	PSA UN	纽约交易所	US	211	192,251.82	0.20
79	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	US	509	192,119.14	0.20
80	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	599	192,091.04	0.20
81	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	US	767	192,067.78	0.20

82	News Corporation	新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	1,196	191,995.88	0.20
83	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	US	515	191,891.29	0.20
84	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	850	191,802.03	0.20
85	Simon Property Group	Simon Property 集团	SPG UN	纽约交易所	US	193	191,779.22	0.20
86	AGL Resources	AGL Resources 公司	GAS UN	纽约交易所	US	763	191,689.58	0.20
87	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	US	606	191,669.53	0.20
88	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	US	1,550	191,635.47	0.20
89	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	US	451	191,573.11	0.20
90	Discovery Communications Inc	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	480	191,521.70	0.20
91	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne 公司	HP UN	纽约交易所	US	544	191,515.67	0.20
92	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	US	332	191,400.01	0.20
93	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	1,214	191,222.76	0.20
94	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	495	191,190.77	0.20
95	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries 公司	NBR UN	纽约交易所	US	2,104	191,096.80	0.20
96	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	574	191,073.17	0.20
97	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	US	1,440	190,978.63	0.20
98	The Bank of New York	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约交易所	US	1,182	190,937.15	0.19

	Mellon Corp							
99	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	709	190,868.45	0.19
100	Forest Laboratories	森林实验室	FRX UN	纽约交易所	US	859	190,701.32	0.19
101	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	US	442	190,667.25	0.19
102	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	828	190,584.91	0.19
103	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	US	224	190,566.30	0.19
104	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	US	277	190,561.59	0.19
105	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	US	197	190,466.62	0.19
106	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UQ	纳斯达克交易所	US	909	190,374.47	0.19
107	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	US	783	190,316.20	0.19
108	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	US	867	190,134.05	0.19
109	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	719	190,080.69	0.19
110	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	437	190,048.57	0.19
111	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	US	337	190,003.75	0.19
112	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,538	189,958.50	0.19
113	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	745	189,930.21	0.19
114	National	美国国民油井	NOV UN	纽约交	US	442	189,889.35	0.19



	Oilwell Varco Inc			易所				
115	TECO Energy Inc	TECO 能源	TE UN	纽约交 易所	US	1,802	189,831.65	0.19
116	JDS Uniphase Corp	捷迪讯	JDSU UQ	纳斯达 克交易 所	US	2,230	189,785.64	0.19
117	Caterpill ar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交 易所	US	337	189,749.57	0.19
118	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交 易所	US	650	189,734.10	0.19
119	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交 易所	US	475	189,675.96	0.19
120	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交 易所	US	199	189,598.46	0.19
121	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克 OMX 集 团股份有限公	NDAQ UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,206	189,583.63	0.19
122	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交 易所	US	1,108	189,569.17	0.19
123	PNC Finl Services Group	PNC 金融服务	PNC UN	纽约交 易所	US	517	189,484.38	0.19
124	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交 易所	US	474	189,425.61	0.19
125	Lilly Eli & Co	礼来	LLY UN	纽约交 易所	US	611	189,410.53	0.19
126	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交 易所	US	518	189,395.06	0.19
127	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交 易所	US	310	189,375.20	0.19
128	Colgate-P almolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交 易所	US	288	189,240.82	0.19
129	AvalonBay Communiti es Inc	AvalonBay 社区股 份有限公司	AVB UN	纽约交 易所	US	222	189,199.71	0.19
130	Flowerserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交 易所	US	205	189,155.84	0.19
131	Cameron Internati	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交 易所	US	533	189,150.68	0.19

	onal Corp							
132	Lowes Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	US	847	189,102.03	0.19
133	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	US	474	189,097.88	0.19
134	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	US	555	189,074.13	0.19
135	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	US	1,161	189,004.36	0.19
136	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	540	188,987.39	0.19
137	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	680	188,831.51	0.19
138	Life Technologies Corp	Life 科技公司	LIFE UQ	纳斯达克交易所	US	612	188,797.31	0.19
139	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	US	737	188,770.85	0.19
140	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	US	457	188,750.23	0.19
141	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	US	929	188,723.90	0.19
142	Bard C.R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	US	307	188,603.84	0.19
143	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	US	859	188,541.62	0.19
144	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	US	682	188,486.68	0.19
145	Bemis Co Inc	Bemis 公司	BMS UN	纽约交易所	US	896	188,440.30	0.19
146	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	US	1,149	188,423.01	0.19
147	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	688	188,371.91	0.19
148	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	474	188,353.05	0.19
149	SLM Corp	SLM 公司	SLM UQ	纳斯达克	US	1,749	188,315.91	0.19

				克交易所				
150	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	807	188,287.43	0.19
151	Delphi Automotive PLC	Delphi Automotive 公司	DLPH UN	纽约交易所	US	783	188,249.15	0.19
152	Washington Post Co B	华盛顿邮报公司	WPO UN	纽约交易所	US	82	188,233.25	0.19
153	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	US	328	188,207.48	0.19
154	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	US	552	188,190.89	0.19
155	Safeway Inc	Safeway 公司	SWY UN	纽约交易所	US	1,655	188,181.27	0.19
156	United Parcel Service Inc B	UPS 公司	UPS UN	纽约交易所	US	406	188,152.55	0.19
157	Abercrombie & Fitch Company A	阿贝克隆比&费奇 公司	ANF UN	纽约交易所	US	624	188,145.63	0.19
158	PETSMART Inc	PetSmart 股份有限公司	PETM UQ	纳斯达克 克交易所	US	438	188,143.37	0.19
159	Pentair Ltd.	Pentair 股份有限公司	PNR UN	纽约交易所	US	609	188,139.79	0.19
160	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	US	158	188,114.71	0.19
161	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	US	1,023	188,079.45	0.19
162	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	943	188,070.90	0.19
163	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UN	纽约交易所	US	1,771	188,013.07	0.19
164	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	US	535	187,977.31	0.19
165	Gannett Co Inc	甘乃特	GCI UN	纽约交易所	US	1,660	187,915.08	0.19

166	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	US	483	187,891.63	0.19
167	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	US	345	187,835.25	0.19
168	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	477	187,776.23	0.19
169	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	US	564	187,744.37	0.19
170	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	US	799	187,726.64	0.19
171	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	US	1,118	187,696.22	0.19
172	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	US	875	187,653.60	0.19
173	Sprint Nextel Corp	斯普林特	S UN	纽约交易所	US	5,264	187,602.56	0.19
174	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	US	624	187,596.53	0.19
175	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	870	187,565.61	0.19
176	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	691	187,542.85	0.19
177	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	1,114	187,514.82	0.19
178	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	1,254	187,513.18	0.19
179	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	US	2,077	187,469.56	0.19
180	SunTrust Banks Inc	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	1,052	187,460.01	0.19

	(GA)							
181	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	551	187,434.36	0.19
182	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	US	355	187,411.30	0.19
183	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	518	187,408.97	0.19
184	Patterson Cos Inc	Patterson Cos 公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	US	871	187,397.97	0.19
185	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	US	490	187,288.41	0.19
186	Fossil Inc	化石公司	FOSL UQ	纳斯达克交易所	US	320	187,257.62	0.19
187	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	505	187,212.99	0.19
188	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics 公司	DGX UN	纽约交易所	US	511	187,156.86	0.19
189	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	US	763	187,133.54	0.19
190	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	US	460	187,126.88	0.19
191	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	402	187,107.39	0.19
192	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	US	414	187,097.96	0.19
193	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	144	187,095.70	0.19
194	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	2,701	187,088.03	0.19
195	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	US	1,069	186,928.13	0.19
196	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	US	388	186,858.86	0.19

197	CareFusion Corp.	CareFusion 公司	CFN UN	纽约交易所	US	1,040	186,825.17	0.19
198	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	US	394	186,628.06	0.19
199	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	US	274	186,603.30	0.19
200	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	US	641	186,542.95	0.19
201	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易 所	US	754	186,537.55	0.19
202	Smucker J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	US	344	186,469.16	0.19
203	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	US	1,019	186,447.35	0.19
204	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	557	186,289.46	0.19
205	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price 公司	TROW UQ	纳斯达克交易 所	US	455	186,265.45	0.19
206	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	US	812	186,238.61	0.19
207	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	US	1,215	186,187.20	0.19
208	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	375	186,184.37	0.19
209	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	US	1,330	186,170.85	0.19
210	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	US	291	186,108.94	0.19
211	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易 所	US	1,487	185,996.12	0.19
212	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	US	2,174	185,976.25	0.19
213	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	US	410	185,960.29	0.19
214	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 公司	MMC UN	纽约交易所	US	858	185,895.30	0.19

215	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	497	185,871.66	0.19
216	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	US	636	185,847.40	0.19
217	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	US	1,091	185,837.72	0.19
218	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	US	378	185,773.11	0.19
219	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	US	369	185,733.51	0.19
220	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店	FDO UN	纽约交易所	US	466	185,730.62	0.19
221	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	US	444	185,697.30	0.19
222	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	265	185,687.50	0.19
223	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	US	320	185,628.41	0.19
224	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股	ZMH UN	纽约交易所	US	443	185,613.20	0.19
224	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	US	443	185,613.20	0.19
225	Archer-Daniels-Midland Co	ADM 公司	ADM UN	纽约交易所	US	1,078	185,588.31	0.19
226	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	318	185,587.56	0.19
227	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	US	737	185,528.16	0.19
228	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合伙企业	DVA UN	纽约交易所	US	267	185,494.60	0.19
229	Northeast	Northeast	NU UN	纽约交易所	US	755	185,456.19	0.19

	Utilities	Utilities 公司		易所				
230	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	US	929	185,337.14	0.19
231	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	60	185,276.43	0.19
232	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	US	462	185,268.88	0.19
233	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	US	262	185,248.64	0.19
234	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	669	185,230.23	0.19
235	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	652	185,195.22	0.19
236	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	US	566	185,172.72	0.19
237	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	551	185,148.58	0.19
238	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	557	185,134.12	0.19
239	Coventry Health Care Inc	Coventry 医疗保健公司	CVH UN	纽约交易所	US	657	185,128.78	0.19
240	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	US	381	185,044.30	0.19
241	Dell Inc	戴尔	DELL UQ	纳斯达克交易所	US	2,906	185,031.17	0.19
242	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	US	303	185,022.81	0.19
243	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	US	396	184,961.90	0.19
244	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	US	1,078	184,910.74	0.19
245	Salesforce.com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	US	175	184,903.70	0.19



246	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	701	184,881.45	0.19
247	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	US	589	184,848.82	0.19
248	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	US	350	184,837.70	0.19
249	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	US	4,130	184,828.90	0.19
250	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	US	433	184,770.88	0.19
251	Walgreen Co	沃尔格林	WAG UN	纽约交易所	US	794	184,705.33	0.19
252	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	US	340	184,685.59	0.19
253	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	368	184,582.51	0.19
254	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	US	718	184,581.25	0.19
255	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	949	184,555.23	0.19
256	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	US	2,867	184,530.21	0.19
257	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	US	351	184,527.45	0.19
258	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	US	870	184,503.31	0.19
259	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	378	184,466.35	0.19
260	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	US	506	184,435.05	0.19
261	The	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交	US	896	184,385.39	0.19

	Williams Companies Inc			易所				
262	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	547	184,354.59	0.19
263	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	US	535	184,345.54	0.19
264	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	321	184,271.56	0.19
265	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	55	184,269.80	0.19
266	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	944	184,235.55	0.19
267	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	US	913	184,211.03	0.19
268	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	US	939	184,204.06	0.19
269	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	492	184,156.35	0.19
270	Molex Inc	Molex 公司	MOLX UQ	纳斯达克交易所	US	1,072	184,151.07	0.19
271	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	465	184,133.72	0.19
272	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	US	1,472	184,119.89	0.19
273	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	US	233	184,119.64	0.19
274	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	517	184,025.05	0.19
275	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	777	184,022.85	0.19
276	Covidien	Covidien 公共股	COV UN	纽约交	US	507	184,002.86	0.19

	Plc	份公司		易所				
277	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交 易所	US	489	183,986.26	0.19
278	Constella tion Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交 易所	US	827	183,961.06	0.19
279	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交 易所	US	498	183,866.71	0.19
280	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交 易所	US	954	183,848.61	0.19
281	Integrays Energy Group Inc	英迪斯能源集团公 司	TEG UN	纽约交 易所	US	560	183,808.13	0.19
282	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公 司	ROST UQ	纳斯达 克交易 所	US	540	183,794.31	0.19
283	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约交 易所	US	1,225	183,792.73	0.19
284	Mondelez Internati onal Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,148	183,785.25	0.19
285	Brown-For man Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交 易所	US	462	183,671.74	0.19
286	Consolida ted Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交 易所	US	526	183,624.85	0.19
287	PG&E Corporati on	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交 易所	US	727	183,604.86	0.19
288	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克墨伦	FCX UN	纽约交 易所	US	854	183,579.34	0.19
289	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交 易所	US	727	183,559.16	0.19
290	Beam Inc	Beam 公司	BEAM UN	纽约交 易所	US	478	183,543.01	0.19
291	NRG Energy	NRG 能源股份有限 公司	NRG UN	纽约交 易所	US	1,270	183,519.63	0.19

292	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	US	504	183,515.98	0.19
293	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	313	183,495.81	0.19
294	Unum Group	Unum 公司	UNM UN	纽约交易所	US	1,402	183,471.48	0.19
295	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	512	183,468.21	0.19
296	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	US	343	183,383.11	0.19
297	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	US	1,570	183,253.12	0.19
298	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	326	183,228.11	0.19
299	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	US	645	183,166.38	0.19
300	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	920	183,079.02	0.19
301	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	1,170	183,041.93	0.19
302	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	US	1,161	183,020.43	0.19
303	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	735	182,991.96	0.19
304	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	US	548	182,969.40	0.19
305	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	US	2,720	182,933.19	0.19
306	Peoples United Financial Inc	People's United 金融公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	2,407	182,912.01	0.19
307	Google Inc	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	41	182,808.55	0.19
308	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	US	470	182,716.34	0.19

309	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	442	182,666.06	0.19
310	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	US	673	182,657.51	0.19
311	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	551	182,655.00	0.19
312	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	313	182,531.80	0.19
313	Wisconsin Energy Corp	威斯康星能源公司	WEC UN	纽约交易所	US	788	182,517.09	0.19
314	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	US	231	182,510.18	0.19
315	First Horizon National Corp	First Horizon National 公司	FHN UN	纽约交易所	US	2,930	182,507.66	0.19
316	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	US	593	182,488.68	0.19
317	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	1,014	182,473.22	0.19
318	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	US	505	182,451.72	0.19
319	CenturyLink Inc	CenturyLink 公司	CTL UN	纽约交易所	US	742	182,449.46	0.19
320	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UQ	纳斯达克交易所	US	279	182,432.68	0.19
321	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	455	182,404.58	0.19
322	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达克交易所	US	803	182,357.38	0.19
323	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	US	789	182,351.97	0.19
324	Phillips	Phillips 66 公司	PSX UN	纽约交	US	546	182,232.99	0.19

	66			易所				
325	Frontier Communica tions Corp	公民通信	FTR UQ	纳斯达 克交易 所	US	6,769	182,099.23	0.19
326	Celgene Corp	Celgene 公司	CELG UQ	纳斯达 克交易 所	US	368	182,084.40	0.19
327	Kimberly- Clark	金佰利	KMB UN	纽约交 易所	US	343	182,024.87	0.19
328	Occidenta l Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交 易所	US	378	182,019.15	0.19
329	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交 易所	US	408	181,924.49	0.19
330	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达 克交易 所	US	293	181,899.92	0.19
331	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交 易所	US	193	181,868.18	0.19
332	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,316	181,812.36	0.19
333	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达 克交易 所	US	366	181,807.96	0.19
334	Kroger Co	Kroger 公司	KR UN	纽约交 易所	US	1,111	181,702.62	0.19
335	Kimco Realty Corp	Kimco Realty 公司	KIM UN	纽约交 易所	US	1,496	181,668.05	0.19
336	Chesapeak e Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交 易所	US	1,739	181,664.65	0.19
337	FirstEner gy Corp	第一能源	FE UN	纽约交 易所	US	692	181,637.88	0.19
338	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有 限公司	VAR UN	纽约交 易所	US	411	181,453.84	0.19
339	Gilead Sciences Inc	Gilead 科学公司	GILD UQ	纳斯达 克交易 所	US	393	181,436.30	0.19

340	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融公司	CINF UQ	纳斯达克交易所	US	737	181,405.31	0.19
341	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	519	181,376.90	0.19
342	Stanley Black & Decker	史丹利 Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	US	390	181,325.99	0.19
343	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	1,487	181,322.85	0.19
344	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	383	181,321.34	0.19
345	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	1,899	181,310.34	0.19
346	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	US	868	181,187.58	0.19
347	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	2,284	181,173.75	0.18
348	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	US	297	181,004.30	0.18
349	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	US	422	180,978.78	0.18
350	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	940	180,796.12	0.18
351	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	US	515	180,788.27	0.18
352	Target Corp	Target 百货	TGT UN	纽约交易所	US	486	180,749.74	0.18
353	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	US	326	180,748.73	0.18
354	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	US	439	180,736.41	0.18
355	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	US	81	180,449.35	0.18
356	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	1,044	180,325.46	0.18

				所				
357	Intl Game Technolog y	国际游戏技术	IGT UN	纽约交 易所	US	2,024	180,268.64	0.18
358	CVS Caremark Corp.	CVS 公司	CVS UN	纽约交 易所	US	593	180,215.03	0.18
359	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交 易所	US	702	180,203.27	0.18
360	QEP Resources	QEP 资源公司	QEP UN	纽约交 易所	US	947	180,178.19	0.18
361	Fidelity National Informati on	富达国民信息服务 公司	FIS UN	纽约交 易所	US	823	180,070.96	0.18
362	Watson Pharmaceu ticals	Actavis 公司	WPI UN	纽约交 易所	US	333	180,004.15	0.18
363	Amazon.co m Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达 克交易 所	US	114	179,953.61	0.18
364	KLA-Tenco r Corporati on	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达 克交易 所	US	599	179,817.09	0.18
365	Legg Mason Inc	Legg Mason 公司	LM UN	纽约交 易所	US	1,112	179,769.32	0.18
366	Assurant Inc	Assurant 公司	AIZ UN	纽约交 易所	US	824	179,720.04	0.18
367	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交 易所	US	969	179,674.16	0.18
368	Prudentia l Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交 易所	US	536	179,670.26	0.18
369	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers 公司	TRV UN	纽约交 易所	US	398	179,666.99	0.18
370	Priceline .com Inc	Priceline.com 股 份有限公司	PCLN UQ	纳斯达 克交易 所	US	46	179,609.42	0.18
371	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交 易所	US	1,129	179,537.14	0.18
372	Verizon	Verizon 通信公司	VZ UN	纽约交	US	660	179,502.57	0.18



	Communications Inc			易所				
373	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	US	430	179,463.60	0.18
374	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	US	696	179,450.52	0.18
375	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UN	纽约交易所	US	11,893	179,408.28	0.18
376	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	US	2,681	179,299.17	0.18
377	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	US	559	179,123.05	0.18
378	Heinz H. J. Co	亨氏	HNZ UN	纽约交易所	US	494	179,098.53	0.18
379	Apollo Group Inc	阿波罗	APOL UQ	纳斯达克交易所	US	1,362	179,093.00	0.18
380	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	US	739	179,064.15	0.18
381	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼	DIS UN	纽约交易所	US	572	179,010.29	0.18
382	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	1,040	178,980.87	0.18
383	Lorillard Inc	Lorillard 股份有限公司	LO UN	纽约交易所	US	244	178,932.35	0.18
384	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	US	416	178,928.57	0.18
385	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	US	394	178,851.89	0.18
386	Biogen Idec Inc	生物基因	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	194	178,847.49	0.18
387	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	2,487	178,830.52	0.18
388	AT&T Inc	美国电话电报集团	T UN	纽约交易所	US	844	178,830.27	0.18

389	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	US	704	178,813.93	0.18
390	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	US	1,355	178,768.73	0.18
391	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	637	178,732.47	0.18
392	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	872	178,624.36	0.18
393	Cardinal Health Inc	Cardinal Health 公司	CAH UN	纽约交易所	US	690	178,597.45	0.18
394	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	US	4,474	178,570.43	0.18
395	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	US	824	178,373.44	0.18
396	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	457	178,150.81	0.18
397	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	US	387	178,106.81	0.18
398	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	829	178,101.03	0.18
399	Hospira Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	US	907	178,097.63	0.18
400	Horton D.R. Inc	DR Horton 公司	DHI UN	纽约交易所	US	1,431	177,912.21	0.18
401	Kohls Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约交易所	US	658	177,759.22	0.18
402	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	US	534	177,757.96	0.18
403	Starwood Hotel & Resort World	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	US	493	177,744.39	0.18
404	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	619	177,572.67	0.18
405	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	US	692	177,549.28	0.18

				所				
406	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克 克交易 所	US	327	177,418.55	0.18
407	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交 易所	US	681	177,338.03	0.18
408	AutoNatio n Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交 易所	US	710	177,169.39	0.18
409	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交 易所	US	917	177,064.04	0.18
410	Southern Co	南方公司	SO UN	纽约交 易所	US	658	177,056.12	0.18
411	Equity Residenti al	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交 易所	US	497	177,031.04	0.18
412	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交 易所	US	467	176,882.90	0.18
413	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源 公司	PXD UN	纽约交 易所	US	264	176,872.46	0.18
414	Big Lots Inc	Big Lots 公司	BIG UN	纽约交 易所	US	988	176,738.71	0.18
415	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交 易所	US	775	176,583.27	0.18
416	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达 克交易 所	US	837	176,505.33	0.18
417	Peabody Energy Corp	博地能源公司	BTU UN	纽约交 易所	US	1,055	176,456.30	0.18
418	Schlumber ger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交 易所	US	405	176,386.53	0.18
419	Kraft Foods Group Inc.	Kraft 食品集团	KRFT UQ	纳斯达 克交易 所	US	617	176,339.64	0.18
420	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交 易所	US	324	176,259.25	0.18
421	Metropcs Communica tions Inc	MetroPCS 通信有 限公司	PCS UN	纽约交 易所	US	2,820	176,187.59	0.18
422	Limited	Limited Brands 公	LTD UN	纽约交	US	595	175,998.40	0.18

	Brands Inc	司		易所				
423	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	356	175,990.23	0.18
424	Staples Inc	Staples 公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	2,455	175,912.29	0.18
425	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	US	4,377	175,799.34	0.18
426	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	US	2,359	175,705.81	0.18
427	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	2,274	175,663.76	0.18
428	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	US	653	175,628.62	0.18
429	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	438	175,506.87	0.18
430	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	3,316	175,495.69	0.18
431	Federated Investors Inc B	联合投资	FII UN	纽约交易所	US	1,378	175,220.51	0.18
432	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	US	1,953	174,927.04	0.18
433	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	520	174,862.61	0.18
434	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	US	480	174,746.96	0.18
435	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	832	174,718.80	0.18
436	Intel Corp	英特尔	INTC UQ	纳斯达克交易所	US	1,346	174,535.64	0.18
437	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	US	3,198	174,476.93	0.18

438	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	US	800	174,435.20	0.18
439	DIRECTV	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	553	174,350.22	0.18
440	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	1,909	174,345.75	0.18
441	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	US	555	174,283.09	0.18
442	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	US	897	174,104.33	0.18
443	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	1,853	174,006.65	0.18
444	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	US	881	173,989.05	0.18
445	Accenture plc	Accenture 公司	ACN UN	纽约交易所	US	416	173,882.07	0.18
446	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	US	93	173,880.69	0.18
447	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath&Beyond 公司	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	494	173,602.62	0.18
448	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	US	144	173,374.20	0.18
449	Chevron Corp	雪佛龙德士古	CVX UN	纽约交易所	US	255	173,327.06	0.18
450	BMC Software Inc	BMC 软件	BMC UQ	纳斯达克交易所	US	695	173,251.64	0.18
451	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	907	172,966.78	0.18
452	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公司	DNR UN	纽约交易所	US	1,698	172,899.02	0.18
453	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	US	1,109	172,801.66	0.18

454	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	US	671	172,667.34	0.18
455	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	US	1,427	172,661.11	0.18
456	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	383	172,414.16	0.18
457	US Bancorp	US Bancorp 公司	USB UN	纽约交易所	US	858	172,251.11	0.18
458	Xerox Corp	施乐	XRK UN	纽约交易所	US	4,004	171,639.91	0.18
459	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	258	171,587.74	0.18
460	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	1,737	171,083.70	0.17
461	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	636	170,896.46	0.17
462	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	180	170,805.95	0.17
463	Windstream Corp	Windstream 公司	WIN UQ	纳斯达克交易 所	US	3,274	170,391.86	0.17
464	Noble Corp	Noble 公司	NE UN	纽约交易所	US	778	170,273.94	0.17
465	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	US	638	170,230.83	0.17
466	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	534	170,205.93	0.17
467	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易 所	US	869	170,089.78	0.17
468	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易 所	US	500	169,708.50	0.17
469	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	US	299	169,462.30	0.17
470	Metlife	大都会集团	MET UN	纽约交	US	818	169,362.29	0.17

	Inc			易所				
471	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	1,256	169,102.07	0.17
472	LSI Corporation	LSI 公司	LSI UQ	纳斯达克交易所	US	3,799	169,060.59	0.17
473	Penney J. C. Inc	彭尼公司	JCP UN	纽约交易所	US	1,363	168,858.26	0.17
474	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UN	纽约交易所	US	720	168,667.62	0.17
475	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	US	427	168,629.97	0.17
476	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	US	132	168,559.01	0.17
477	WPX Energy Inc.	WPX 能源公司	WPX UN	纽约交易所	US	1,800	168,350.83	0.17
478	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	US	340	167,760.00	0.17
479	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	1,062	167,480.79	0.17
480	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	US	284	167,458.54	0.17
481	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	US	742	167,431.89	0.17
482	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	478	166,778.07	0.17
483	Rowan Cos Plc	Rowan 公司	RDC UN	纽约交易所	US	847	166,475.80	0.17
484	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	54	166,439.91	0.17
485	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	US	600	166,276.62	0.17
486	Avon	雅芳	AVP UN	纽约交	US	1,840	166,078.00	0.17

	Products			易所				
487	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	US	851	166,031.73	0.17
488	IntercontinentalExchange	洲际交易所公司 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	US	213	165,758.25	0.17
489	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	US	398	164,832.33	0.17
490	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	US	456	164,347.22	0.17
491	SAIC Inc	SAIC 公司	SAI UN	纽约交易所	US	2,309	164,289.64	0.17
492	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	US	421	163,640.73	0.17
493	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	875	163,564.42	0.17
494	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	US	715	162,417.95	0.17
495	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	US	573	161,963.57	0.17
496	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	US	495	161,913.22	0.17
497	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	960	161,290.96	0.16
498	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	1,294	160,472.71	0.16
499	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	US	554	156,941.27	0.16

#### 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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	Fossil Inc	FOSL UQ	313,282.67	0.24
2	Monster Beverage Corp	MNST UQ	290,880.48	0.22
3	Crown Castle Intl Corp	CCI UN	265,235.27	0.20
4	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	229,242.08	0.17
5	WPX Energy Inc.	WPX UN	227,113.08	0.17
6	PETSMART Inc	PETM UQ	224,380.67	0.17
7	EnSCO PLC - CL A	ESV UN	220,297.02	0.17
8	LyondellBasell Industries N.V.	LYB UN	219,757.64	0.17
9	Seagate Technology	STX UQ	219,679.41	0.17
10	First Solar Inc	FSLR UQ	211,423.67	0.16
11	Advanced Micro Devices	AMD UN	199,961.02	0.15
12	Apollo Group Inc	APOL UQ	198,045.32	0.15
13	Alpha Natural Resources	ANR UN	196,657.00	0.15
14	Dollar General Corp	DG UN	186,767.69	0.14
15	Delphi Automotive PLC	DLPH UN	185,445.17	0.14
16	Garmin Ltd	GRMN UQ	178,649.09	0.13
17	Phillips 66	PSX UN	172,423.43	0.13
18	Pentair Ltd.	PNR UN	172,212.62	0.13
19	The ADT Corp.	ADT UN	144,048.25	0.11
20	Allegheny Technologies Inc	ATI UN	143,089.56	0.11

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	Sears Holdings Corp	SHLD UQ	423,136.43	0.32
2	Pulte Group Inc	PHM UN	419,645.89	0.32
3	Sunoco Inc	SUN UN	391,616.62	0.29
4	Sprint Nextel Corp	S UN	344,896.84	0.26
5	Tenet Healthcare	THC UN	335,906.69	0.25
6	Titanium Metals Corp	TIE UN	334,390.78	0.25

7	Duke Energy Corp	DUK UN	331,890.36	0.25
8	Express Scripts Holding Co.	ESRX UQ	331,506.71	0.25
9	Tesoro Corp	TSO UN	329,004.73	0.25
10	NetFlix Inc	NFLX UQ	321,629.22	0.24
11	Whirlpool Corp	WHR UN	321,051.77	0.24
12	First Solar Inc	FSLR UQ	319,441.84	0.24
13	Expedia	EXPE UQ	307,436.62	0.23
14	Bank of America Corp	BAC UN	280,978.02	0.21
15	Constellation Brands Inc A	STZ UN	274,305.99	0.21
16	Metropcs Communications Inc	PCS UN	271,813.92	0.20
17	Lennar Corp	LEN UN	271,487.82	0.20
18	Lexmark International Inc	LXK UN	270,587.93	0.20
19	Sara Lee Corp	SLE UN	269,016.14	0.20
20	Motorola Mobility Holdings, Inc	MMI UN	267,272.33	0.20

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	18,559,437.01
卖出收入（成交）总额	69,266,317.05

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	-
3	应收股利	103,766.75
4	应收利息	295.32
5	应收申购款	58,859.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,921.76

#### 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

5,337	18,251.63	1,308,406.03	1.34%	96,100,531.79	98.66%
-------	-----------	--------------	-------	---------------	--------

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基金	44,468.40	0.05%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：0。

2、本基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：0。

## § 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	150,455,310.00
本报告期基金总申购份额	39,428,510.24
减：本报告期基金总赎回份额	92,474,882.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	97,408,937.82

## § 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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

### 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	1	35,192,750.53	40.07%	10,557.55	38.51%	-
摩根士丹利	1	27,556,053.76	31.38%	8,189.98	29.88%	-
美林证券	1	13,335,756.59	15.18%	5,142.42	18.76%	-
野村证券	1	11,113,263.11	12.65%	3,333.76	12.16%	-
花旗银行	1	627,930.07	0.71%	188.45	0.69%	-

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、境内交易单元包括：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、中银国际、东莞证券、渤海证券、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、广发证券、西南证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金退租的境内交易单元：中邮证券，新增境内交易单元：广发证券、西南证券。新增境外交易单元：花旗银行。

### 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	2012-1-12
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-1-20
3	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	2012-2-16
4	关于旗下部分基金增加中信证券(浙江)有限责任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	2012-2-23
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-3-28
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-3-28
7	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	2012-3-30
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-4-21
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-5-9
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-5-9
11	关于旗下部分基金增加信达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	2012-5-9
12	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	2012-5-23
13	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	中国证监会指定报刊及本公司网站	2012-6-29

	的公告		
14	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	2012-7-3
15	关于增加上海好买基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-7-12
16	关于增加通联支付为网上直销第三方支付渠道的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-7-13
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-7-20
18	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年半年度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-8-25
19	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-8-25
20	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	2012-8-29
21	关于旗下部分基金增加上海农村商业银行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	2012-9-20
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-10-25
23	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年 10 月 29 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	2012-10-30
24	关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年 10 月 30 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	2012-10-31
25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2012 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-11-8
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2012 年第 2 期）	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-11-8
27	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	2012-11-19
28	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	2012-12-18
29	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	2012-12-20
30	关于增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构及相关申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2012-12-27
31	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2013 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	2012-12-31

## § 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  
2013 年 3 月 26 日