

大成标普 500 等权重指数证券投资基金  
2013 年半年度报告  
2013 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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遵规守信情况的说明.....	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.....	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>25</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	25
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	26
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	26
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	26
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	53
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	55
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	55
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	55
7.11 投资组合报告附注.....	55

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,904,589.19 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	95566
	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	田国立

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

## 2.6 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,958,835.98
本期利润	10,322,851.55
加权平均基金份额本期利润	0.1231
本期加权平均净值利润率	11.18%
本期基金份额净值增长率	12.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,622,644.73
期末可供分配基金份额利润	0.0214
期末基金资产净值	85,532,242.71
期末基金份额净值	1.127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.70%

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。

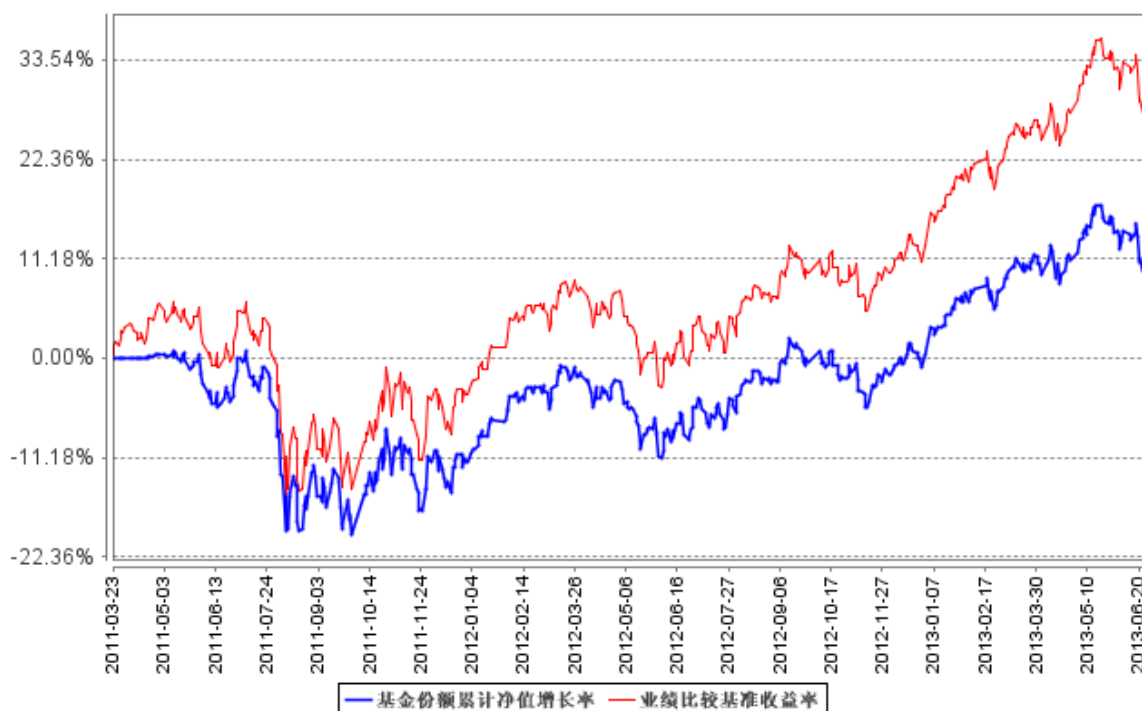
### 3.2 净值表现

#### 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
过去一个月	-1.23%	1.03%	-1.08%	1.13%	-0.15%	-0.10%
过去三个月	1.08%	0.91%	3.24%	0.97%	-2.16%	-0.06%
过去六个月	12.14%	0.85%	16.17%	0.87%	-4.03%	-0.02%
过去一年	19.13%	0.80%	26.46%	0.84%	-7.33%	-0.04%
自基金合同生效起至今	12.70%	1.19%	31.01%	1.27%	-18.31%	-0.08%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



注：1、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。截至本报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

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。

## § 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 2013 年 6 月 30 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，3 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、大成中证 100ETF，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 28 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、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债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		
冉凌浩 先生	本基金基金经理	2011 年 8 月 26 日	-	10 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。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。

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2013 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 7 笔同日反向交易，原因是投资组合投资策略需要。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，但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%；投资组合间不存在债券同日反向交易。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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但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。

## 4.5 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

2013 年上半年，全球宏观经济基本保持小幅增长的状况。欧洲方面来看，欧洲的金融体系保持了相对的稳定，但是其宏观经济增长状况依然不乐观，仍然保持轻微的衰退状态。日本实施了量化宽松政策，这增加了全球资本市场的资金供应。

2013 年上半年，美国的宏观经济继续保持平稳的增长。美国 1 季度的 GDP 年化季环比增长率为 1.1%，2 季度的 GDP 年化季环比增长率为 1.7%，保持了平稳的增长，但增长速度仍然低于长期潜在增长水平。经济增长的动力主要包括欣欣向荣的房地产市场、由就业改善带来的个人消费支出增加及企业补库存等几个方面，而美国各级政府减少支出给经济增长带来了负面影响。

由于经济增长状况较佳，美联储已经在逐步探讨退出量化宽松政策的条件与时间，因此市场参与者已经开始考虑美联储退出量化宽松政策对宏观经济以及对资本市场的影响，这造成了全球

金融市场的短期波动。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 16.17%，美元兑人民币中间价下跌 1.70%，经汇率调整后的目标指数上涨 14.19%。在本报告期内，本基金净值上涨 12.14%，低于经汇率调整后的目标指数 2.05%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 0.92%，日均偏差绝对值为 0.048%，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 1.127 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.14% 同期业绩比较基准收益率为 16.17%，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 年下半年，欧元区金融体系有望保持稳定，同时，最新的经济数据表明，欧洲的宏观经济有望逐步走出衰退。同时，美国宏观经济增速会比上半年有所提高，并推动企业盈利水平持续上涨。宏观经济的进一步改善可以从这些方面得以体现。

(1) 劳动市场持续改善，个人消费持续增加。从多项劳动力市场指标来看，美国的劳动力市场在持续改善。而劳动力市场的改善会改善消费者信心指数，并持续推动个人消费的增加。

(2) 生产领域显著向好。在能源成本大幅降低的推动下，制造业逐步回流美国。近期 ISM 制造业指数更是创出了两年的新高，表明美国的制造业在逐步复苏。

(3) 房地产市场持续复苏。美国的住宅销量持续增加，美国房价也出现明显涨幅，但房价绝对价格也仅只回到了 2004 年下半年的水平附近，未来还有足够的上涨空间。同时，美国住宅购买力指数依然处于历史高位，这意味着居民对房价还有着非常高的购买能力，当前房价还是处于相对低估的水平。因此美国房地产市场有望持续复苏。

从当前的市场一致预期来看，未来美国宏观经济增速会持续提高，至明年就已经会超过长期的趋势增长水平，并有望推动标普 500 等权重指数的企业盈利水平持续增加。

由于宏观经济较好，美联储可能在一定的经济条件下于今年晚些时候开始缩减其资产购买规模。但是，美联储退出量化宽松政策的条件是不会给经济带来下行风险，因此对金融状况和经济增长的影响也应较为有限。

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，持续实施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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	15,407,018.97	8,454,928.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	79,634,073.24	92,182,351.63
其中：股票投资		79,634,073.24	92,182,351.63
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,120,393.06	-
应收利息	6.4.3.5	984.58	295.32
应收股利		100,257.99	103,766.75
应收申购款		1,451,740.70	58,859.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	130,042.24	-
资产总计		97,844,510.78	100,800,202.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012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	6.4.3.3	-	-
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		12,004,667.53	1,181,414.49
应付管理人报酬		76,606.67	83,679.53
应付托管费		19,151.65	20,919.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	211,842.22	174,541.29
负债合计		12,312,268.07	2,866,329.27
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	75,904,589.19	97,408,937.82
未分配利润	6.4.3.10	9,627,653.52	524,935.25
所有者权益合计		85,532,242.71	97,933,873.07
负债和所有者权益总计		97,844,510.78	100,800,202.34

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 75,904,589.19 份。

## 6.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日

<b>一、收入</b>		11,171,559.38	11,002,136.23
1. 利息收入		12,691.80	13,490.66
其中：存款利息收入	6.4.3.11	12,691.80	13,451.52
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		-	39.14
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,067,807.18	1,690,451.38
其中：股票投资收益	6.4.3.12	3,220,570.67	597,540.40
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	847,236.51	1,092,910.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	7,364,015.57	9,275,416.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-319,281.46	-28,317.45
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	46,326.29	51,095.50
<b>减：二、费用</b>		848,707.83	1,121,983.40
1. 管理人报酬	6.4.6.1.1	459,566.38	662,407.76
2. 托管费	6.4.6.1.2	114,891.57	165,601.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	15,213.35	14,703.30
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	259,036.53	279,270.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,322,851.55	9,880,152.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,322,851.55	9,880,152.83

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	97,408,937.82	524,935.25	97,933,873.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	10,322,851.55	10,322,851.55

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)	-21,504,348.63	-1,220,133.28	-22,724,481.91
其中：1. 基金申购款	41,872,652.39	4,673,891.89	46,546,544.28
2. 基金赎回款	-63,377,001.02	-5,894,025.17	-69,271,026.19
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)	75,904,589.19	9,627,653.52	85,532,242.71
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	9,880,152.83	9,880,152.83
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)	-19,002,865.08	702,343.24	-18,300,521.84
其中：1. 基金申购款	27,688,859.66	-1,084,714.53	26,604,145.13
2. 基金赎回款	-46,691,724.74	1,787,057.77	-44,904,666.97
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)	131,452,444.92	-7,078,196.92	124,374,248.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王颢 主管会计工作负责人：刘彩晖 会计机构负责人：范瑛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明。

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

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

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	15,407,018.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,407,018.97

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	72,298,059.09	79,634,073.24	7,336,014.15
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	72,298,059.09	79,634,073.24	7,336,014.15

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.3.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	984.58
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	984.58

**6.4.3.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
待摊费用	130,042.24
合计	130,042.24

**6.4.3.7 应付交易费用**

本基金于本期末无应付交易费用。

**6.4.3.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43,238.91
预提费用	148,767.52
预提审计费	19,835.79
合计	211,842.22

**6.4.3.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	97,408,937.82	97,408,937.82



本期申购	41,872,652.39	41,872,652.39
本期赎回(以“-”号填列)	-63,377,001.02	-63,377,001.02
本期末	75,904,589.19	75,904,589.19

#### 6.4.3.10 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	-1,576,241.73	2,101,176.98	524,935.25
本期利润	2,958,835.98	7,364,015.57	10,322,851.55
本期基金份额交易产生的变动数	240,050.48	-1,460,183.76	-1,220,133.28
其中：基金申购款	-13,571.00	4,687,462.89	4,673,891.89
基金赎回款	253,621.48	-6,147,646.65	-5,894,025.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,622,644.73	8,005,008.79	9,627,653.52

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	12,691.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	12,691.80

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	35,713,508.27
减：卖出股票成本总额	32,492,937.60
买卖股票差价收入	3,220,570.67

#### 6.4.3.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

#### 6.4.3.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

## 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	847,236.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	847,236.51

## 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,364,015.57
——股票投资	7,364,015.57
——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	7,364,015.57

## 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	46,281.76
其他	44.53
合计	46,326.29

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	15,213.35
银行间市场交易费用	-
合计	15,213.35

## 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	5,039.81
税收费用	8,476.15
指数授权费	59,597.91
数据使用费	17,319.35
合计	259,036.53

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

##### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)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。

##### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.6.1 关联方报酬

##### 6.4.6.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付 的管理费	459,566.38	662,407.76

其中：支付销售机构的客户维护费	176,032.47	278,974.84
-----------------	------------	------------

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

#### 6.4.6.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	114,891.57	165,601.93

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.6.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间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。

#### 6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.6.4 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	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	10,824,593.66	-	6,553,575.62	-
中国银行	4,582,425.31	12,691.80	1,664,613.43	13,451.52

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。

#### 6.4.6.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.6.6 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。

#### 6.4.7 利润分配情况

本报告期及上年度可比期间内本基金无利润分配。

#### 6.4.8 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2012 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.9.3 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。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所承担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。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2013 年 6 月 30 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	15,407,018.97	-	-	-	15,407,018.97
交易性金融资产	-	-	-	79,634,073.24	79,634,073.24
应收证券清算款	-	-	-	1,120,393.06	1,120,393.06
应收利息	-	-	-	984.58	984.58
应收股利	-	-	-	100,257.99	100,257.99
应收申购款	71,438.98	-	-	1,380,301.72	1,451,740.70
其他资产	-	-	-	130,042.24	130,042.24
<b>资产总计</b>	<b>15,478,457.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>82,366,052.83</b>	<b>97,844,510.78</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	12,004,667.53	12,004,667.53
应付管理人报酬	-	-	-	76,606.67	76,606.67
应付托管费	-	-	-	19,151.65	19,151.65
其他负债	-	-	-	211,842.22	211,842.22
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12,312,268.07</b>	<b>12,312,268.07</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>15,478,457.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>70,053,784.76</b>	<b>85,532,242.71</b>

上年度末 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>

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（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（2012 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.9.4.2 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。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 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	10,824,593.66	-	-	10,824,593.66
交易性金融资产	79,634,073.24	-	-	79,634,073.24
应收股利	100,257.99	-	-	100,257.99
应收证券清算款	1,120,393.06	-	-	1,120,393.06
资产合计	91,679,317.95	-	-	91,679,317.95
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	91,679,317.95	-	-	91,679,317.95

项目	上年度末 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

#### 6.4.9.4.2.2 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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 428	增加约 490
美元相对人民币贬值 5%	减少约 428	减少约 490	

#### 6.4.9.4.3 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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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	79,634,073.24	93.10	92,182,351.63	94.13
交易性金融资产-基金投资	-	0.00	-	0.00
交易性金融资产-债券投资	-	0.00	-	0.00
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	79,634,073.24	93.10	92,182,351.63	94.13

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,080,000.00	4,900,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-4,080,000.00	-4,900,000.00	

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	79,634,073.24	81.39
	其中: 普通股股票	79,634,073.24	81.39
	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	15,407,018.97	15.75
8	其他各项资产	2,803,418.57	2.87
9	合计	97,844,510.78	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	79,634,073.24	93.10
合计	79,634,073.24	93.10

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 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 (%)
消费者非必需品	13,292,364.60	15.54
金融	13,087,157.15	15.30
信息技术	11,197,350.18	13.09
工业	9,666,065.44	11.30
医疗保健	8,597,748.35	10.05
能源	6,788,299.92	7.94
消费者常用品	6,291,914.19	7.36
公用事业	4,982,683.11	5.83
基础材料	4,642,408.21	5.43
电信服务	1,088,082.09	1.27
合计	79,634,073.24	93.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

无。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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	Cablevision Systems Co A	有线电视系统 公司	CVC UN	纽约交易 所	US	1,786	185,611.36	0.22

2	Micron Technology Inc	美光技术公司	MU UQ	纳斯达克交易所	US	2,054	181,862.74	0.21
3	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	1,198	176,835.75	0.21
4	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	1,056	175,971.35	0.21
5	Peoples United Financial Inc	People's United Financial 公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	1,905	175,379.31	0.21
6	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	3,097	175,280.57	0.20
7	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	252	175,135.00	0.20
8	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	672	174,512.19	0.20
9	Schwab Charles Corp	嘉信理财公司	SCHW UN	纽约交易所	US	1,330	174,461.16	0.20
10	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	US	232	173,448.47	0.20
11	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	972	173,444.51	0.20
12	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	225	172,691.58	0.20
13	Adobe Systems Inc	奥多比公司	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	612	172,278.96	0.20
14	E*TRADE Financial Corp	亿创金融有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	2,201	172,167.37	0.20
15	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	384	171,991.28	0.20
16	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	456	171,951.24	0.20
17	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF UN	纽约交易所	US	2,919	171,879.51	0.20
18	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	2,518	171,759.95	0.20
19	Range	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易	US	359	171,507.61	0.20

	Resources Corp			所				
20	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务公司	HIG UN	纽约交易所	US	897	171,367.73	0.20
21	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	US	944	171,306.19	0.20
22	Hospira Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	US	723	171,138.44	0.20
23	Lincoln National Corp	林肯国民公司	LNC UN	纽约交易所	US	759	171,030.93	0.20
24	Electronic Arts	电子艺界公司	EA UQ	纳斯达克交易所	US	1,202	170,593.54	0.20
25	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne 公司	HP UN	纽约交易所	US	442	170,550.04	0.20
26	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	US	659	170,525.45	0.20
27	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	US	433	169,993.46	0.20
28	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	507	169,786.97	0.20
29	WellPoint Inc	WellPoint 公司	WLP UN	纽约交易所	US	335	169,397.71	0.20
30	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	US	795	169,171.57	0.20
31	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	245	169,165.08	0.20
32	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	572	169,006.23	0.20
33	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	US	756	168,906.87	0.20
34	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻探公司	DO UN	纽约交易所	US	397	168,738.01	0.20
35	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	US	596	168,511.44	0.20
36	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	US	218	168,436.92	0.20
37	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	US	323	168,398.86	0.20
38	Genworth	Genworth 金融	GNW UN	纽约交易所	US	2,383	167,999.04	0.20

	Financial Inc	公司		所				
39	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	445	167,995.76	0.20
40	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	US	372	167,857.73	0.20
41	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	246	167,849.20	0.20
42	Linear Technology Corp	凌特公司	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	737	167,758.38	0.20
43	Advanced Micro Devices	AMD 公司	AMD UN	纽约交易所	US	6,654	167,741.32	0.20
44	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	US	375	167,728.53	0.20
45	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	662	167,538.66	0.20
46	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	533	167,428.68	0.20
47	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	US	799	167,258.15	0.20
48	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	US	748	167,073.28	0.20
49	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	140	167,000.38	0.20
50	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	560	166,637.07	0.19
51	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	US	429	166,488.10	0.19
52	Baker Hughes Inc	贝克休斯公司	BHI UN	纽约交易所	US	584	166,453.68	0.19
53	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	US	423	166,433.42	0.19
54	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	652	166,256.71	0.19
55	PNC Finl Services Group	PNC 金融服务集团	PNC UN	纽约交易所	US	369	166,253.25	0.19
56	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	US	119	166,177.31	0.19

57	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	442	165,961.98	0.19
58	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	US	792	165,939.62	0.19
59	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	599	165,917.68	0.19
60	Unitedhealth Group Inc	联合健康公司	UNH UN	纽约交易所	US	410	165,878.32	0.19
61	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	674	165,869.80	0.19
62	IntercontinentalExchange	洲际交易所公司	ICE UN	纽约交易所	US	151	165,847.18	0.19
63	American Express Co	美国运通公司	AXP UN	纽约交易所	US	359	165,829.14	0.19
64	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	344	165,659.35	0.19
65	NYSE Euronext	纽约-泛欧交易所集团	NYX UN	纽约交易所	US	647	165,501.42	0.19
66	Weyerhaeuser Co	惠好公司	WY UN	纽约交易所	US	940	165,469.29	0.19
67	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	377	165,431.85	0.19
68	SAIC Inc	SAIC 公司	SAI UN	纽约交易所	US	1,922	165,425.18	0.19
69	CME Group Inc	芝加哥商业交易所控股公司	CME UQ	纳斯达克交易所	US	352	165,249.08	0.19
70	TECO Energy Inc	TECO 能源公司	TE UN	纽约交易所	US	1,555	165,159.43	0.19
71	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	328	165,128.48	0.19
72	Eaton Corp plc	伊顿公司	ETN UN	纽约交易所	US	406	165,087.82	0.19
73	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	310	165,011.45	0.19
74	Xilinx Inc	赛灵思公司	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	674	164,953.62	0.19
75	Integrus Energy Group Inc	英迪斯能源集团公司	TEG UN	纽约交易所	US	456	164,907.53	0.19
76	Wisconsin Energy Corp	威斯康星能源公司	WEC UN	纽约交易所	US	651	164,875.46	0.19

77	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	392	164,820.53	0.19
78	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理公司	AIV UN	纽约交易所	US	888	164,820.04	0.19
79	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融公司	CINF UQ	纳斯达克交易所	US	581	164,772.95	0.19
80	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	96	164,713.27	0.19
81	Sempra Energy	桑普拉能源公司	SRE UN	纽约交易所	US	326	164,685.59	0.19
82	Salesforce.com	Salesforce.com 有限公司	CRM UN	纽约交易所	US	698	164,660.13	0.19
83	Best Buy Co Inc	百思买公司	BBY UN	纽约交易所	US	975	164,642.27	0.19
84	Discovery Communications Inc	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	345	164,584.81	0.19
85	Amerisource Bergen Corp	美源伯根公司	ABC UN	纽约交易所	US	477	164,544.40	0.19
86	Hasbro Inc	孩之宝公司	HAS UQ	纳斯达克交易所	US	594	164,532.73	0.19
87	Waste Management Inc	废品管理公司	WM UN	纽约交易所	US	660	164,463.40	0.19
88	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	382	164,463.15	0.19
89	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	843	164,436.89	0.19
90	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	444	164,435.97	0.19
91	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	763	164,389.32	0.19
92	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	879	164,344.40	0.19
93	Ecolab Inc	艺康化工公司	ECL UN	纽约交易所	US	312	164,225.40	0.19
94	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔公司	HON UN	纽约交易所	US	335	164,223.05	0.19
95	Northern Trust Corp	北美信托公司	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	459	164,205.75	0.19

	(IL)							
96	Mattel Inc	美泰公司	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	586	164,054.74	0.19
97	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	1,317	164,048.93	0.19
98	CA Inc	冠群国际公司	CA UQ	纳斯达克交易所	US	927	163,982.76	0.19
99	Dominion Resources Inc	多米诺资源公司	D UN	纽约交易所	US	467	163,951.43	0.19
100	PG&E Corporation	太平洋煤气电力公司	PCG UN	纽约交易所	US	580	163,880.13	0.19
101	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	US	435	163,871.17	0.19
102	Waters Corp	活德公司	WAT UN	纽约交易所	US	265	163,817.42	0.19
103	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	385	163,804.13	0.19
104	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品公司	STJ UN	纽约交易所	US	581	163,803.70	0.19
105	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	US	665	163,737.09	0.19
106	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	US	816	163,707.87	0.19
107	Home Depot Inc	家得宝公司	HD UN	纽约交易所	US	342	163,703.05	0.19
108	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	US	803	163,679.76	0.19
109	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	296	163,649.54	0.19
110	Biogen Idec Inc	生物基因公司	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	123	163,547.72	0.19
111	Priceline.com Inc	Priceline.com 有限公司	PCLN UQ	纳斯达克交易所	US	32	163,538.82	0.19
112	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	235	163,523.62	0.19
113	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,088	163,422.17	0.19
114	Johnson & Johnson	强生公司	JNJ UN	纽约交易所	US	308	163,394.98	0.19



115	AFLAC Inc	家庭人寿保险 公司	AFL UN	纽约交易 所	US	455	163,393.25	0.19
116	Airgas Inc	Airgas 股份有 限公司	ARG UN	纽约交易 所	US	277	163,379.78	0.19
117	Jabil Circuit Inc	捷普科技公司	JBL UN	纽约交易 所	US	1,296	163,194.79	0.19
118	Quanta Services Inc	Quanta 服务股 份有限公司	PWR UN	纽约交易 所	US	998	163,161.43	0.19
119	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR UQ	纳斯达克 交易所	US	492	163,122.13	0.19
120	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易 所	US	405	163,004.61	0.19
121	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公 司	PBI UN	纽约交易 所	US	1,797	162,993.86	0.19
122	United Parcel Service Inc B	联合包裹服务 股份有限公司	UPS UN	纽约交易 所	US	305	162,971.86	0.19
123	Ford Motor Co	福特汽车公司	F UN	纽约交易 所	US	1,705	162,971.55	0.19
124	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易 所	US	632	162,953.08	0.19
125	Public Storage	Public Storage 公司	PSA UN	纽约交易 所	US	172	162,949.37	0.19
126	Assurant Inc	Assurant 公司	AIZ UN	纽约交易 所	US	518	162,940.85	0.19
127	Time Warner Inc	时代华纳公司	TWX UN	纽约交易 所	US	456	162,907.11	0.19
128	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克 OMX 集团	NDAQ UQ	纳斯达克 交易所	US	804	162,890.06	0.19
129	Lockheed Martin	洛克希德马丁 公司	LMT UN	纽约交易 所	US	243	162,844.46	0.19
130	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克 交易所	US	3,344	162,813.19	0.19
131	Marathon Oil Corp	马拉松石油公 司	MRO UN	纽约交易 所	US	762	162,808.50	0.19
132	Western Union Co	西联汇款公司	WU UN	纽约交易 所	US	1,540	162,805.04	0.19
133	Discover Financial Services	Discover 金融 服务公司	DFS UN	纽约交易 所	US	553	162,777.36	0.19
134	Intuitive	直觉外科手术	ISRG UQ	纳斯达克	US	52	162,760.30	0.19

	Surgical Inc	公司		交易所				
135	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	707	162,720.70	0.19
136	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	US	266	162,709.89	0.19
137	Boeing Co	波音公司	BA UN	纽约交易所	US	257	162,667.13	0.19
138	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	1,025	162,635.74	0.19
139	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	336	162,616.46	0.19
140	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	US	144	162,598.67	0.19
141	JDS Uniphase Corp	捷迪讯公司	JDSU UQ	纳斯达克交易所	US	1,830	162,594.96	0.19
142	Microsoft Corp	微软公司	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	762	162,573.09	0.19
143	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	301	162,564.13	0.19
144	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	US	579	162,560.11	0.19
145	Sealed Air Corp	希悦尔包装公司	SEE UN	纽约交易所	US	1,098	162,481.89	0.19
146	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	763	162,456.44	0.19
147	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	1,807	162,449.45	0.19
148	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	437	162,410.53	0.19
149	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	577	162,355.10	0.19
150	General Electric Co	通用电气公司	GE UN	纽约交易所	US	1,133	162,340.83	0.19
151	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	504	162,305.06	0.19
152	DTE Energy Co	DTE 能源公司	DTE UN	纽约交易所	US	392	162,301.60	0.19
153	Total System	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	1,073	162,296.16	0.19

	Services Inc							
154	Hewlett-Packard Co	惠普公司	HPQ UN	纽约交易所	US	1,059	162,272.43	0.19
155	Kraft Foods Group Inc.	Kraft 食品公司	KRFT UQ	纳斯达克交易所	US	470	162,245.87	0.19
156	Whole Foods Market Inc	全食超市公司	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	510	162,220.53	0.19
157	Hershey Foods Corp	好时食品公司	HSY UN	纽约交易所	US	294	162,180.49	0.19
158	Scripps Networks Interactive	斯科利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	US	393	162,108.57	0.19
159	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	US	151	162,096.59	0.19
160	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	944	162,090.53	0.19
161	Noble Corp	Noble 公司	NE UN	纽约交易所	US	698	162,072.49	0.19
162	BMC Software Inc	BMC 软件公司	BMC UQ	纳斯达克交易所	US	581	162,044.69	0.19
163	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股公司	LH UN	纽约交易所	US	262	162,043.82	0.19
164	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	803	162,042.46	0.19
165	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	471	162,038.14	0.19
166	eBay Inc.	易趣公司	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	507	162,018.12	0.19
167	Omnicom Group	奥姆尼康公司	OMC UN	纽约交易所	US	417	161,985.68	0.19
168	Fluor Corp	福陆公司	FLR UN	纽约交易所	US	442	161,974.74	0.19
169	Southern Co	南方公司	SO UN	纽约交易所	US	594	161,963.62	0.19
170	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	US	451	161,956.83	0.19
171	First Solar	福思第一太阳	FSLR UQ	纳斯达克	US	586	161,954.73	0.19

	Inc	能公司		交易所				
172	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	616	161,948.67	0.19
173	News Corporation	美国新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	804	161,946.20	0.19
174	Kellogg Co	家乐氏公司	K UN	纽约交易所	US	408	161,918.02	0.19
175	EOG Resources	EOG 资源公司	EOG UN	纽约交易所	US	199	161,908.63	0.19
176	Campbell Soup Co	金宝汤公司	CPB UN	纽约交易所	US	585	161,895.22	0.19
177	Smucker J.M. Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	US	254	161,882.56	0.19
178	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	US	284	161,858.21	0.19
179	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	US	470	161,839.31	0.19
180	Becton Dickinson & Co	碧迪公司	BDX UN	纽约交易所	US	265	161,819.84	0.19
181	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan 公司	MMC UN	纽约交易所	US	656	161,804.83	0.19
182	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	404	161,778.38	0.19
183	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶公司	GT UQ	纳斯达克交易所	US	1,712	161,736.62	0.19
184	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	US	194	161,712.27	0.19
185	Reynolds American Inc	雷诺兹美国公司	RAI UN	纽约交易所	US	541	161,685.27	0.19
186	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼公司	NOC UN	纽约交易所	US	316	161,664.45	0.19
187	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	US	775	161,659.51	0.19
188	Forest Laboratories	森林实验室公司	FRX UN	纽约交易所	US	638	161,622.43	0.19

189	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	716	161,606.86	0.19
190	AGL Resources	AGL 资源公司	GAS UN	纽约交易所	US	610	161,539.64	0.19
191	NetApp Inc	网域存储技术公司	NTAP UQ	纳斯达克交易所	US	692	161,534.45	0.19
192	WPX Energy Inc.	WPX 能源公司	WPX UN	纽约交易所	US	1,380	161,493.92	0.19
193	Northeast Utilities	Northeast Utilities 公司	NU UN	纽约交易所	US	622	161,489.22	0.19
194	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	399	161,452.58	0.19
195	Actavis Inc	Actavis 公司	ACT UN	纽约交易所	US	207	161,434.23	0.19
196	Life Technologies Corp	Life 科技公司	LIFE UQ	纳斯达克交易所	US	353	161,421.81	0.19
197	Washington Post Co B	华盛顿邮报公司	WPO UN	纽约交易所	US	54	161,409.76	0.19
198	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油公司	APC UN	纽约交易所	US	304	161,404.45	0.19
199	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	329	161,342.72	0.19
200	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM UN	纽约交易所	US	289	161,332.96	0.19
201	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	US	769	161,263.20	0.19
202	Target Corp	Target 百货公司	TGT UN	纽约交易所	US	379	161,251.34	0.19
203	Express Scripts Holding Co.	快捷药方公司	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	423	161,232.37	0.19
204	Costco Wholesale Corp	好市多批发公司	COST UQ	纳斯达克交易所	US	236	161,230.21	0.19
205	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦公司	DD UN	纽约交易所	US	497	161,217.73	0.19
206	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath&Beyond 公司	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	368	161,209.70	0.19

207	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	US	319	161,208.52	0.19
208	SLM Corp	SLM 公司	SLM UQ	纳斯达克交易所	US	1,141	161,160.64	0.19
209	Lorillard Inc	Lorillard 公司	LO UN	纽约交易所	US	597	161,121.71	0.19
210	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	308	161,054.24	0.19
211	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股公司	LLL UN	纽约交易所	US	304	161,047.57	0.19
212	Noble Energy Inc	Noble 能源有限公司	NBL UN	纽约交易所	US	434	161,000.61	0.19
213	Duke Energy Corp	杜克能源公司	DUK UN	纽约交易所	US	386	160,986.03	0.19
214	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	416	160,928.94	0.19
215	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	US	609	160,898.54	0.19
216	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	564	160,857.76	0.19
217	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	US	520	160,838.98	0.19
218	JP Morgan Chase & Co	摩根大通银行	JPM UN	纽约交易所	US	493	160,803.57	0.19
219	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	530	160,788.31	0.19
220	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	426	160,770.27	0.19
221	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	US	682	160,759.27	0.19
222	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢公司	SLB UN	纽约交易所	US	363	160,723.93	0.19
223	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	US	753	160,699.46	0.19
224	DIRECTV	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	422	160,668.69	0.19
225	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	404	160,630.14	0.19

226	Genuine Parts Co	原配部件公司	GPC UN	纽约交易所	US	333	160,629.58	0.19
227	Bemis Co Inc	Bemis 公司	BMS UN	纽约交易所	US	664	160,577.99	0.19
228	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车公司	HOG UN	纽约交易所	US	474	160,551.54	0.19
229	Grainger W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWV UN	纽约交易所	US	103	160,488.89	0.19
230	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	US	385	160,450.03	0.19
231	Marriott Intl A	万豪国际公司	MAR UN	纽约交易所	US	643	160,386.14	0.19
232	Centerpoint Energy Inc	中点能源公司	CNP UN	纽约交易所	US	1,105	160,377.12	0.19
233	ConocoPhillips	康菲石油公司	COP UN	纽约交易所	US	429	160,365.07	0.19
234	Equity Residential	公寓物业权益信托公司	EQR UN	纽约交易所	US	447	160,354.69	0.19
235	Zoetis Inc	Zoetis 公司	ZTS UN	纽约交易所	US	840	160,322.44	0.19
236	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化公司	ROK UN	纽约交易所	US	312	160,273.50	0.19
237	Kimberly-Clark	金佰利公司	KMB UN	纽约交易所	US	267	160,253.11	0.19
238	Tyco Intl	泰科国际公司	TYC UN	纽约交易所	US	787	160,223.89	0.19
239	Fossil Group Inc	化石集团	FOSL UQ	纳斯达克交易所	US	251	160,218.70	0.19
240	NRG Energy	NRG 能源有限公司	NRG UN	纽约交易所	US	971	160,187.12	0.19
241	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	US	540	160,151.90	0.19
242	Staples Inc	Staples 公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	1,634	160,122.49	0.19
243	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	US	687	160,112.61	0.19
244	Symantec Corp	赛门铁克公司	SYMC UQ	纳斯达克交易所	US	1,153	160,077.20	0.19
245	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	US	390	160,075.91	0.19
246	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	US	526	160,062.31	0.19

247	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	US	1,019	160,046.74	0.19
248	Delphi Automotive PLC	Delphi Automotive 公司	DLPH UN	纽约交易所	US	511	160,044.33	0.19
249	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼公司	DIS UN	纽约交易所	US	410	159,975.81	0.19
250	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	US	755	159,960.06	0.19
251	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际公司	RHI UN	纽约交易所	US	779	159,942.88	0.19
252	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	320	159,914.64	0.19
253	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	838	159,888.94	0.19
254	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 公司	CMG UN	纽约交易所	US	71	159,835.86	0.19
255	Procter & Gamble	宝洁公司	PG UN	纽约交易所	US	336	159,834.57	0.19
256	Cardinal Health Inc	Cardinal 保健公司	CAH UN	纽约交易所	US	548	159,815.78	0.19
257	Tenet Healthcare	Tenet 保健公司	THC UN	纽约交易所	US	561	159,794.16	0.19
258	Dover Corp	多佛公司	DOV UN	纽约交易所	US	333	159,786.00	0.19
259	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	469	159,756.28	0.19
260	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	45	159,734.84	0.19
261	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	1,432	159,704.57	0.19
262	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	US	61	159,689.06	0.19
263	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	US	537	159,660.33	0.19
264	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	US	372	159,652.17	0.19
265	United Technologies Corp	联合技术公司	UTX UN	纽约交易所	US	278	159,641.05	0.19



266	Verizon Communications Inc	Verizon 通讯股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	US	513	159,561.34	0.19
267	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	265	159,560.29	0.19
268	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	US	396	159,553.56	0.19
269	Citrix Systems Inc	思杰系统公司	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	428	159,541.70	0.19
270	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	US	512	159,535.02	0.19
271	Apache Corp	阿帕契公司	APA UN	纽约交易所	US	308	159,531.81	0.19
272	Caterpillar Inc	卡特彼勒公司	CAT UN	纽约交易所	US	313	159,530.14	0.19
273	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	236	159,451.24	0.19
274	Principal Financial Group	信安金融公司	PFG UN	纽约交易所	US	689	159,429.31	0.19
275	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具公司	ITW UN	纽约交易所	US	373	159,412.99	0.19
276	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	2,006	159,392.91	0.19
277	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店公司	FDO UN	纽约交易所	US	414	159,387.85	0.19
278	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇公司	SIAL UQ	纳斯达克交易所	US	321	159,383.03	0.19
279	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	577	159,360.41	0.19
280	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品公司	CAG UN	纽约交易所	US	738	159,276.63	0.19
281	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	900	159,262.17	0.19
282	General Mills Inc	通用磨坊公司	GIS UN	纽约交易所	US	531	159,221.58	0.19
283	Pioneer Natural	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	US	178	159,197.29	0.19

	Resources							
284	Textron Inc	德事隆公司	TXT UN	纽约交易所	US	989	159,184.63	0.19
285	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰公司	IR UN	纽约交易所	US	464	159,171.22	0.19
286	Penney J.C. Inc	彭尼公司	JCP UN	纽约交易所	US	1,508	159,142.55	0.19
287	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	US	527	159,129.27	0.19
288	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	122	159,119.94	0.19
289	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	705	159,080.52	0.19
290	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯公司	COL UN	纽约交易所	US	406	159,067.30	0.19
291	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	US	1,263	159,039.37	0.19
292	Hess Corp	阿美拉达赫斯公司	HES UN	纽约交易所	US	387	158,988.02	0.19
293	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞爾工业公司	LYB UN	纽约交易所	US	388	158,847.46	0.19
294	Gilead Sciences Inc	Gilead 科学公司	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	502	158,838.44	0.19
295	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	US	600	158,817.30	0.19
296	CenturyLink Inc	CenturyLink 公司	CTL UN	纽约交易所	US	727	158,789.19	0.19
297	Baxter Intl Inc	百特公司	BAX UN	纽约交易所	US	371	158,787.46	0.19
298	United States Steel Corp	美国钢铁公司	X UN	纽约交易所	US	1,465	158,677.98	0.19
299	Chevron Corp	雪佛龙德士古公司	CVX UN	纽约交易所	US	217	158,667.66	0.19
300	Mylan Inc.	迈兰实验室公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	827	158,556.63	0.19
301	Gannett Co Inc	甘乃特公司	GCI UN	纽约交易所	US	1,049	158,536.42	0.19
302	Rowan Cos Plc	Rowan 公司	RDC UN	纽约交易所	US	753	158,512.76	0.19

303	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	388	158,511.83	0.19
304	Ryder System Inc	Ryder 系统公司	R UN	纽约交易所	US	422	158,504.54	0.19
305	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	287	158,496.38	0.19
306	Moody's Corp	穆迪公司	MCO UN	纽约交易所	US	421	158,493.11	0.19
307	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	303	158,477.17	0.19
308	Bard C.R. Inc	CR 巴德公司	BCR UN	纽约交易所	US	236	158,474.26	0.19
309	Emerson Electric Co	艾默生电气公司	EMR UN	纽约交易所	US	470	158,383.56	0.19
310	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	1,827	158,377.44	0.19
311	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	US	229	158,358.10	0.19
312	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	558	158,353.53	0.19
313	Union Pacific Corp	联合太平洋公司	UNP UN	纽约交易所	US	166	158,239.47	0.19
314	LSI Corporation	LSI 公司	LSI UQ	纳斯达克交易所	US	3,586	158,199.68	0.18
315	Celgene Corp	Celgene 公司	CELG UQ	纳斯达克交易所	US	219	158,195.05	0.18
316	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	419	158,076.73	0.18
317	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	447	158,062.33	0.18
318	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	448	158,028.41	0.18
319	Praxair Inc	普莱克斯公司	PX UN	纽约交易所	US	222	157,961.68	0.18
320	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	266	157,927.20	0.18
321	Boston Scientific Corp	波士顿科学公司	BSX UN	纽约交易所	US	2,757	157,911.45	0.18
322	CareFusion Corp.	CareFusion 公司	CFN UN	纽约交易所	US	693	157,785.77	0.18

323	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕公司	CBG UN	纽约交易所	US	1,093	157,757.53	0.18
324	Google Inc	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	29	157,746.72	0.18
325	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	US	307	157,705.02	0.18
326	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	532	157,680.67	0.18
327	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮公司	YUM UN	纽约交易所	US	368	157,662.63	0.18
328	Xylem Inc	Xylem 公司	XYL UN	纽约交易所	US	947	157,632.11	0.18
329	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	US	322	157,631.37	0.18
330	Teradyne Inc	泰瑞达公司	TER UN	纽约交易所	US	1,452	157,628.77	0.18
331	Stanley Black & Decker	史丹利 Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	US	330	157,612.46	0.18
332	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers 公司	TRV UN	纽约交易所	US	319	157,522.74	0.18
333	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄公司	CL UN	纽约交易所	US	445	157,520.09	0.18
334	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	US	1,052	157,429.82	0.18
335	McGraw Hill Financial Inc	麦格希公司	MHFI UN	纽约交易所	US	479	157,420.98	0.18
336	Medtronic Inc	美敦力公司	MDT UN	纽约交易所	US	495	157,418.76	0.18
337	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	410	157,290.55	0.18
338	Amgen Inc	安进公司	AMGN UQ	纳斯达克交易所	US	258	157,274.36	0.18
339	Halliburton Co	哈利伯顿公司	HAL UN	纽约交易所	US	610	157,242.97	0.18
340	Danaher Corp	丹纳赫公司	DHR UN	纽约交易所	US	402	157,226.91	0.18
341	Agilent Technologies Inc	安捷伦公司	A UN	纽约交易所	US	595	157,199.72	0.18

342	AES Corp	爱伊斯公司	AES UN	纽约交易所	US	2,121	157,129.22	0.18
343	Occidental Petroleum	西方石油公司	OXY UN	纽约交易所	US	285	157,127.74	0.18
344	Patterson Cos Inc	Patterson Cos 公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	US	676	157,047.73	0.18
345	L Brands Inc	L Brands 有限公司	LTD UN	纽约交易所	US	516	157,019.30	0.18
346	Dell Inc	戴尔公司	DELL UQ	纳斯达克交易所	US	1,903	156,970.18	0.18
347	Intl Game Technology	国际游戏技术公司	IGT UN	纽约交易所	US	1,520	156,934.04	0.18
348	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	431	156,931.75	0.18
349	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	US	915	156,884.92	0.18
350	CVS Caremark Corp.	CVS 公司	CVS UN	纽约交易所	US	444	156,864.34	0.18
351	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生公司	ED UN	纽约交易所	US	435	156,721.80	0.18
352	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	1,701	156,703.63	0.18
353	Merck & Co Inc	默克公司	MRK UN	纽约交易所	US	546	156,702.34	0.18
354	Kohls Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约交易所	US	502	156,667.24	0.18
355	Deere & Co	迪尔公司	DE UN	纽约交易所	US	312	156,630.05	0.18
356	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics 公司	DGX UN	纽约交易所	US	418	156,588.89	0.18
357	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔公司	NWL UN	纽约交易所	US	965	156,514.19	0.18
358	Pentair Ltd.	Pentair 有限公司	PNR UN	纽约交易所	US	439	156,481.20	0.18
359	PETSMART Inc	PetSmart 有限公司	PETM UQ	纳斯达克交易所	US	378	156,458.40	0.18
360	Beam Inc	Beam 公司	BEAM UN	纽约交易所	US	401	156,365.04	0.18
361	Tiffany & Co	蒂芙尼公司	TIF UN	纽约交易所	US	347	156,169.61	0.18

362	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜公 司	TAP UN	纽约交易 所	US	528	156,136.24	0.18
363	Sherwin-Wil liams Co	宣威威廉斯公 司	SHW UN	纽约交易 所	US	143	156,035.65	0.18
364	Xcel Energy Inc	Xcel 能源公司	XEL UN	纽约交易 所	US	891	156,017.98	0.18
365	Leggett & Platt	礼恩派公司	LEG UN	纽约交易 所	US	812	155,981.78	0.18
366	Analog Devices Inc	模拟器件公司	ADI UQ	纳斯达克 交易所	US	560	155,910.84	0.18
367	Stryker Corp	史赛克公司	SYK UN	纽约交易 所	US	390	155,858.94	0.18
368	MeadWestvac o Corp	MeadWestvaco 公司	MWV UN	纽约交易 所	US	739	155,748.28	0.18
369	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有 限公司	HRL UN	纽约交易 所	US	653	155,658.38	0.18
370	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易 所	US	220	155,641.45	0.18
371	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛公司	EL UN	纽约交易 所	US	383	155,640.90	0.18
372	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易 所	US	499	155,638.49	0.18
373	Sprint Corp	Sprint 公司	S UN	纽约交易 所	US	3,582	155,367.37	0.18
374	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易 所	US	1,302	155,342.53	0.18
375	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克 交易所	US	552	155,320.65	0.18
376	Cameron Internation al Corp	卡梅隆国际公 司	CAM UN	纽约交易 所	US	411	155,312.50	0.18
377	Edwards Lifescience s Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易 所	US	374	155,288.03	0.18
378	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern 公司	KSU UN	纽约交易 所	US	237	155,162.73	0.18
379	Vornado Realty Trust	沃那多房地产 信托公司	VNO UN	纽约交易 所	US	303	155,107.30	0.18
380	Intl	国际香料公司	IFF UN	纽约交易	US	334	155,106.62	0.18

	Flavors & Fragrances			所				
381	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	238	155,096.86	0.18
382	Xerox Corp	施乐公司	XRX UN	纽约交易所	US	2,767	155,064.92	0.18
383	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price 公司	TROW UQ	纳斯达克交易所	US	343	155,026.36	0.18
384	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	445	154,825.56	0.18
385	AbbVie Inc.	AbbVie 公司	ABBV UN	纽约交易所	US	606	154,789.04	0.18
386	Loews Corp	罗斯公司	L UN	纽约交易所	US	564	154,724.53	0.18
387	Yahoo Inc	雅虎公司	YHOO UQ	纳斯达克交易所	US	997	154,681.72	0.18
388	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货公司	WMT UN	纽约交易所	US	336	154,644.46	0.18
389	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	US	624	154,644.46	0.18
390	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝公司	BMJ UN	纽约交易所	US	560	154,630.62	0.18
391	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	411	154,576.06	0.18
392	Health Care REIT Inc	Health Care REIT 公司	HCN UN	纽约交易所	US	373	154,481.03	0.18
393	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	1,757	154,480.54	0.18
394	Lowes Cos Inc	劳氏公司	LOW UN	纽约交易所	US	611	154,405.10	0.18
395	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	657	154,298.02	0.18
396	CMS Energy Corp	CMS 能源公司	CMS UN	纽约交易所	US	919	154,277.38	0.18
397	Molex Inc	Molex 公司	MOLX UQ	纳斯达克交易所	US	851	154,271.88	0.18
398	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	559	154,250.87	0.18
399	Starwood Hotel & Resort	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	US	395	154,220.66	0.18

	World							
400	Johnson Controls Inc	江森自控公司	JCI UN	纽约交易所	US	697	154,131.56	0.18
401	Allegheny Technologies Inc	冶联科技公司	ATI UN	纽约交易所	US	948	154,108.39	0.18
402	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	730	154,077.01	0.18
403	Ball Corp	波尔公司	BLL UN	纽约交易所	US	600	153,997.92	0.18
404	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	97	153,938.91	0.18
405	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品公司	APD UN	纽约交易所	US	272	153,893.13	0.18
406	Legg Mason Inc	Legg Mason 公司	LM UN	纽约交易所	US	803	153,855.99	0.18
407	PPG Industries Inc	PPG 工业公司	PPG UN	纽约交易所	US	170	153,785.99	0.18
408	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井公司	NOV UN	纽约交易所	US	361	153,682.19	0.18
409	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	US	782	153,649.44	0.18
410	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries 公司	NBR UN	纽约交易所	US	1,624	153,623.74	0.18
411	Abbott Laboratories	雅培制药公司	ABT UN	纽约交易所	US	712	153,445.30	0.18
412	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	US	194	153,429.48	0.18
413	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业公司	PCL UN	纽约交易所	US	532	153,407.48	0.18
414	AT&T Inc	美国电话电报集团	T UN	纽约交易所	US	701	153,326.91	0.18
415	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	US	339	153,260.37	0.18
416	Morgan Stanley	摩根士丹利公司	MS UN	纽约交易所	US	1,015	153,209.83	0.18
417	Simon	Simon Property	SPG UN	纽约交易所	US	157	153,191.23	0.18



	Property Group	公司		所				
418	Eastman Chemical Co	伊士曼化工公司	EMN UN	纽约交易所	US	354	153,130.06	0.18
419	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	US	571	153,081.56	0.18
420	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	US	616	153,080.51	0.18
421	Dow Chemical	陶氏化学公司	DOW UN	纽约交易所	US	770	153,051.96	0.18
422	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案有限公司	MSI UN	纽约交易所	US	429	153,022.73	0.18
423	American Electric Power	美国电力公司	AEP UN	纽约交易所	US	553	153,005.25	0.18
424	Altria Group Inc	高特利公司	MO UN	纽约交易所	US	707	152,848.25	0.18
425	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	US	110	152,841.27	0.18
426	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	1,462	152,391.09	0.18
427	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达克交易所	US	556	152,323.74	0.18
428	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	569	152,299.27	0.18
429	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	US	456	152,172.48	0.18
430	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	US	258	152,077.58	0.18
431	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默公司	PKI UN	纽约交易所	US	757	152,011.47	0.18
432	Intl Paper Co	国际纸业公司	IP UN	纽约交易所	US	555	151,946.90	0.18
433	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	595	151,869.05	0.18
434	FirstEnergy Corp	第一能源公司	FE UN	纽约交易所	US	658	151,808.93	0.18
435	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	810	151,743.93	0.18

436	FedEx Corp	联邦快递公司	FDX UN	纽约交易所	US	249	151,664.97	0.18
437	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合 伙公司	DVA UN	纽约交易所	US	203	151,516.55	0.18
438	Kimco Realty Corp	Kimco Realty 公 司	KIM UN	纽约交易所	US	1,144	151,476.51	0.18
439	Monsanto Co.	孟山都公司	MON UN	纽约交易所	US	248	151,392.98	0.18
440	McCormick & Co	味好美公司	MKC UN	纽约交易所	US	348	151,287.20	0.18
441	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公 司	DNR UN	纽约交易所	US	1,413	151,212.31	0.18
442	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	696	151,201.19	0.18
443	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	US	679	151,199.96	0.18
444	Alcoa Inc	美铝公司	AA UN	纽约交易所	US	3,129	151,185.25	0.18
445	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克墨 伦铜金矿公司	FCX UN	纽约交易所	US	886	151,146.20	0.18
446	General Motors Company	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	US	734	151,066.37	0.18
447	Safeway Inc	美国西夫韦有 限公司	SWY UN	纽约交易所	US	1,033	151,012.25	0.18
448	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	1,051	150,591.54	0.18
449	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	US	1,890	150,526.11	0.18
450	F5 Networks Inc	F5 Networks 公 司	FFIV UQ	纳斯达克 交易所	US	354	150,483.47	0.18
451	Brown-Forman Corp B	布朗福曼公司	BF/B UN	纽约交易所	US	360	150,253.63	0.18
452	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	399	150,112.20	0.18
453	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部 资本公司	PNW UN	纽约交易所	US	437	149,774.10	0.18

454	The Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行有限公司	BK UN	纽约交易所	US	864	149,742.03	0.18
455	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE UN	纽约交易所	US	865	149,701.56	0.18
456	Franklin Resources Inc	富兰克林资源公司	BEN UN	纽约交易所	US	178	149,595.97	0.17
457	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股公司	ZMH UN	纽约交易所	US	323	149,559.26	0.17
458	Goldman Sachs Group Inc	高盛集团	GS UN	纽约交易所	US	160	149,524.54	0.17
459	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	US	481	149,281.28	0.17
460	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	US	526	149,012.33	0.17
461	Frontier Communications Corp	公民通信公司	FTR UQ	纳斯达克交易所	US	5,953	148,966.29	0.17
462	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	906	148,960.18	0.17
463	Avon Products	雅芳公司	AVP UN	纽约交易所	US	1,146	148,909.02	0.17
464	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	US	844	148,778.89	0.17
465	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOY UN	纽约交易所	US	496	148,726.75	0.17
466	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	447	148,616.70	0.17
467	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	US	1,017	148,421.89	0.17
468	Devon Energy Corp	戴文能源公司	DVN UN	纽约交易所	US	463	148,415.09	0.17
469	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	1,478	148,396.93	0.17
470	Covidien Plc	Covidien 公司	COV UN	纽约交易所	US	382	148,318.95	0.17
471	Norfolk	诺福克南方公	NSC UN	纽约交易	US	330	148,131.24	0.17

	Southern Corp	司		所				
472	Lilly Eli & Co	礼来公司	LLY UN	纽约交易所	US	488	148,106.90	0.17
473	QEP Resources	QEP 资源公司	QEP UN	纽约交易所	US	862	147,957.37	0.17
474	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK UQ	纳斯达克交易所	US	705	147,842.08	0.17
475	Intl Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM UN	纽约交易所	US	125	147,601.42	0.17
476	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	1,256	147,215.68	0.17
477	Horton D.R. Inc	DR Horton 公司	DHI UN	纽约交易所	US	1,119	147,129.18	0.17
478	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	907	146,939.00	0.17
479	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	60	146,835.57	0.17
480	Computer Sciences	电脑系统咨询公司	CSC UN	纽约交易所	US	541	146,308.96	0.17
481	Valero Energy Corp	Valero 能源公司	VLO UN	纽约交易所	US	681	146,301.54	0.17
482	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业公司	NEM UN	纽约交易所	US	790	146,191.13	0.17
483	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	US	273	146,109.33	0.17
484	Masco Corp	马斯可公司	MAS UN	纽约交易所	US	1,211	145,832.09	0.17
485	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	US	137	145,171.65	0.17
486	Cummins Inc	康明斯公司	CMI UN	纽约交易所	US	216	144,750.63	0.17
487	Windstream Corp	Windstream 公司	WIN UQ	纳斯达克交易所	US	3,030	144,342.46	0.17
488	Abercrombie & Fitch Company A	阿贝克隆比&费奇公司	ANF UN	纽约交易所	US	516	144,266.47	0.17
489	Phillips 66	Phillips 66 公	PSX UN	纽约交易	US	394	143,410.96	0.17

		司		所				
490	Oracle Corp	甲骨文公司	ORCL UQ	纳斯达克交易所	US	754	143,116.49	0.17
491	Whirlpool Corp	惠而浦公司	WHR UN	纽约交易所	US	202	142,732.42	0.17
492	Walgreen Co	沃尔格林公司	WAG UN	纽约交易所	US	522	142,557.44	0.17
493	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	440	142,238.62	0.17
494	Peabody Energy Corp	博地能源公司	BTU UN	纽约交易所	US	1,562	141,292.53	0.17
495	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	US	838	140,317.04	0.16
496	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料公司	VMC UN	纽约交易所	US	469	140,283.00	0.16
497	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	318	139,620.58	0.16
498	Accenture plc	Accenture 公司	ACN UN	纽约交易所	US	312	138,721.21	0.16
499	Apollo Group Inc	阿波罗公司	APOL UQ	纳斯达克交易所	US	1,245	136,310.77	0.16
500	Allergan Inc	爱力根公司	AGN UN	纽约交易所	US	259	134,807.87	0.16

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	Aetna Inc	AET UN	261,399.27	0.27
2	Regeneron Pharmaceuticals Inc	REGN UQ	230,887.43	0.24
3	Kansas City Southern Inc	KSU UN	202,947.20	0.21
4	Macerich Co	MAC UN	188,687.27	0.19
5	PVH Corp	PVH UN	177,893.79	0.18
6	General Motors Company	GM UN	169,364.05	0.17
7	Zoetis Inc	ZTS UN	160,253.91	0.16
8	Flowserve Corp	FLS UN	101,453.04	0.10
9	Peabody Energy Corp	BTU UN	94,765.64	0.10
10	Cliffs Natural Resources Inc	CLF UN	88,644.87	0.09
11	Abbott Laboratories	ABT UN	81,627.11	0.08

12	Penney J.C. Inc	JCP UN	80,440.07	0.08
13	AbbVie Inc.	ABBV UN	77,438.24	0.08
14	Newmont Mining Corp	NEM UN	72,172.59	0.07
15	United States Steel Corp	X UN	68,479.02	0.07
16	First Solar Inc	FSLR UQ	67,930.88	0.07
17	Apollo Group Inc	APOL UQ	63,408.51	0.06
18	Apple Inc.	AAPL UQ	60,438.51	0.06
19	Coach Inc	COH UN	59,681.39	0.06
20	F5 Networks Inc	FFIV UQ	57,396.15	0.06

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 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	Aetna Inc	AET UN	281,766.65	0.29
2	Heinz H.J. Co	HNZ UN	232,767.33	0.24
3	NetFlix Inc	NFLX UQ	225,530.67	0.23
4	First Horizon National Corp	FHN UN	211,698.79	0.22
5	Big Lots Inc	BIG UN	210,452.57	0.21
6	Best Buy Co Inc	BBY UN	206,764.58	0.21
7	Federated Investors Inc B	FII UN	188,278.04	0.19
8	T-MOBILE US INC	TMUS UN	178,413.86	0.18
9	Micron Technology Inc	MU UQ	174,076.22	0.18
10	First Solar Inc	FSLR UQ	163,600.94	0.17
11	Flowserve Corp	FLS UN	156,802.85	0.16
12	NYSE Euronext	NYX UN	154,731.77	0.16
13	GameStop Corp A	GME UN	153,934.15	0.16
14	Dean Foods Co	DF UN	152,250.41	0.16
15	Boston Scientific Corp	BSX UN	146,267.21	0.15
16	Advanced Micro Devices	AMD UN	141,003.67	0.14
17	Hewlett-Packard Co	HPQ UN	134,463.84	0.14
18	Genworth Financial Inc	GNW UN	128,770.02	0.13
19	Actavis Inc	ACT UN	127,350.60	0.13
20	Western Digital Corp	WDC UQ	127,088.71	0.13

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 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	12,684,376.50
卖出收入（成交）总额	35,713,508.27

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

**7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 投资组合报告附注**

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

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

**7.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,120,393.06
3	应收股利	100,257.99
4	应收利息	984.58
5	应收申购款	1,451,740.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	130,042.24
8	其他	-
9	合计	2,803,418.57

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

**7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,243	14,477.32	33,352.67	0.04%	75,871,236.52	99.96%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	42,537.11	0.06%

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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	97,408,937.82
本报告期基金总申购份额	41,872,652.39
减：本报告期基金总赎回份额	63,377,001.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,904,589.19

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

2013年6月1日，中国银行股份有限公司发布公告，自2013年5月31日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。



## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	1	24,273,262.49	56.99%	7,281.78	50.57%	-
高盛证券	1	18,068,491.28	42.42%	7,042.12	48.91%	-
野村证券	1	247,828.36	0.58%	74.35	0.52%	-
美林证券	1	-	-	-	-	-
花旗银行	1	-	-	-	-	-

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、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、华福证券、东海证券、民生证券、万联证券、齐鲁证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无退租的境内交易单元, 新增的境内交易单元: 华福证券、东海证券、渤海证券、民生证券、万联证券、齐鲁证券。本报告期内本基金无新增或退租境外交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成标普 500 等权重指数证券投资基金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	2013-1-17
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-1-19
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	2013-2-7
4	关于全面启用综合对帐服务方式的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-19
5	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-26
6	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	2013-3-26
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-3-26
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-4-22
9	大成基金管理有限公司关于港澳台居民投资旗下基金开立证券投资基金账户的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-4-25
10	关于增加华鑫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	2013-4-26
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书摘要 (2013 年第 1 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-5-8

12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书（2013 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-5-8
13	大成基金管理有限公司开通支付宝网上直销交易的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2013-5-21
14	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	2013-5-22
15	关于旗下部分基金增加中信万通证券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	2013-6-15

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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 8 月 29 日