

大成标普 500 等权重指数证券投资基金  
2014 年半年度报告  
2014 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：2014 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2014 年 8 月 26 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 2014 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 基金净值表现.....	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合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
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.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	30
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	30
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.....	30
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	54
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序的前五名债券投资明细.....	55
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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.....	56
7.11 投资组合报告附注.....	56

<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.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 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	106,343,135.22 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	王永民
	联系电话	0755-83183388	010-66594896
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,397,363.40
本期利润	10,402,535.31
加权平均基金份额本期利润	0.1062
本期加权平均净值利润率	8.11%
本期基金份额净值增长率	7.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,087,250.69
期末可供分配基金份额利润	0.0572
期末基金资产净值	146,321,114.52

期末基金份额净值	1.376
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	38.12%

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。

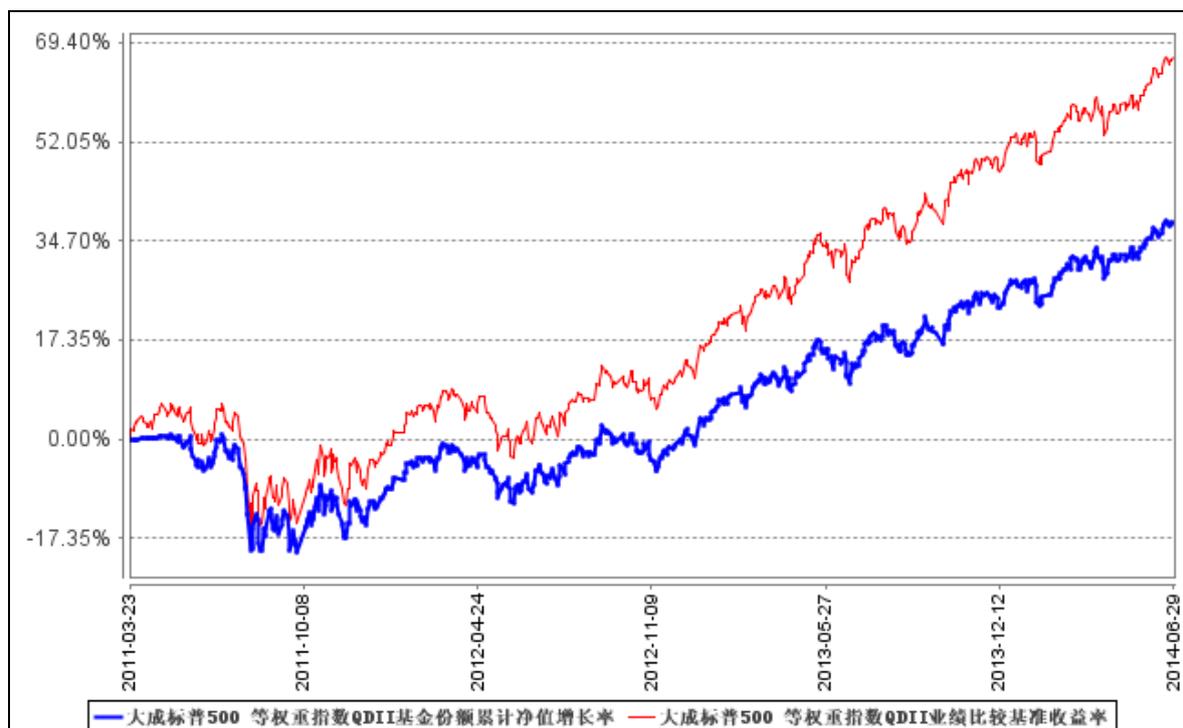
### 3.2 基金净值表现

#### 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	2.30%	0.36%	2.89%	0.38%	-0.59%	-0.02%
过去三个月	4.64%	0.58%	5.53%	0.61%	-0.89%	-0.03%
过去六个月	7.99%	0.62%	8.66%	0.65%	-0.67%	-0.03%
过去一年	22.56%	0.63%	27.35%	0.66%	-4.79%	-0.03%
过去三年	40.08%	1.11%	60.86%	1.17%	-20.78%	-0.06%
自基金合同生效起至今	38.12%	1.07%	66.85%	1.14%	-28.73%	-0.07%

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。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。

## § 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2014年6月30日，本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金，4只ETF及1只ETF联接基金：深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金，1只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金及37只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金

(LOF)、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、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、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、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成健康产业股票型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成招财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

#### 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	-	11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间连续 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。2014 年上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 11 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，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% 的仅有 3 笔，原因为投资策略需要；投资组合间存在 1 笔债券同日反向交易，原因为投资策略需要。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

2014 年上半年，全球宏观经济基本保持相对稳定的增长状况，股票市场也呈现小幅上涨的情

形。

从欧洲方面来看，虽然经济增长依然比较疲软，但是已经不再继续衰退，同时金融系统保持相对稳定。

2014 年 1 季度，美国本土遭遇近二十年来最严寒天气，期间社会经济活动减弱，1 季度的宏观经济数据也相对疲弱，GDP 环比增长率甚至出现了负增长。因此，1 季度的美国主要股票指数出现了区间小幅震动的情况。

但是，恶劣的天气状况不改美国宏观经济全面向好的趋势。在严冬过后，美国社会经济活动逐步恢复到正常状况，至 2 季度期间，美国宏观经济更是出现了爆发式的增长，各项宏观经济指标屡创金融危机之后的最佳水平，2 季度的 GDP 年化环比增速甚至达到了年化 4% 的水平。这都表明了美国宏观经济继续维持了全面向好的趋势。

2014 年上半年，美国联邦储备委员会更换了主席，新任主席也被市场公认为鸽派，对宽松货币政策持支持立场。由于经济的持续好转，美联储正在逐步退出量化宽松政策，但此行为仅造成美国股票市场在极短期内的波动，并不会改变美国宏观经济持续向好的趋势。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 8.66%，美元兑人民币中间价上涨 0.92%，经汇率调整后的目标指数上涨 9.65%。在本报告期内，本基金净值上涨 7.99%，低于经汇率调整后的目标指数 1.66%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 0.83%，日均偏差绝对值为 0.042%，均显著优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 1.376 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.99%，同期业绩比较基准收益率为 8.66%，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 2014 年下半年，美国经济活动预计依然保持强劲增长。经济增长的来源依然在于个人消费的持续增加及企业投资意愿的增强，住宅市场也有望保持持续回暖，进一步推对经济增长。

虽然会逐步退出量化宽松政策，但美联储将继续维持宽松的货币政策助力经济复苏，因此美联储逐步消减量化宽松政策规模的行为不会改变美国宏观经济及股票市场的长期趋势。

过往 30 年以来，标普 500 指数的年化复合增长率在 11% 左右，而当前标普 500 指数的动态市盈率处于 16 至 17 倍之间，基本位于历史平均水平区间内。因此，未来由强劲的宏观经济增长带来的指数成分股公司盈利的持续增加有望推动标普 500 指数持续上涨。

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。本报告期内大成标普 500 等权重指数证券投资基金已分配利润 437,546.23 元（每十份基金份额分红 0.048 元），符合基金合同规定的分红比例。

### § 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合规守信、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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	11,391,838.17	9,287,850.70
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	138,390,457.51	105,853,653.46
其中：股票投资		138,390,457.51	105,853,653.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		266,979.10	-
应收利息	6.4.3.5	1,067.59	307.74
应收股利		141,170.52	128,843.41
应收申购款		566,013.25	683,023.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	103,595.22	-

资产总计		150,861,121.36	115,953,678.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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		65,766.91	2,134,315.56
应付赎回款		4,144,348.74	1,088,259.01
应付管理人报酬		118,338.57	93,310.77
应付托管费		29,584.65	23,327.68
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	181,967.97	142,535.34
负债合计		4,540,006.84	3,481,748.36
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	106,343,135.22	87,946,838.33
未分配利润	6.4.3.10	39,977,979.30	24,525,092.27
所有者权益合计		146,321,114.52	112,471,930.60
负债和所有者权益总计		150,861,121.36	115,953,678.96

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.376 元，基金份额总额 106,343,135.22 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
<b>一、收入</b>		11,482,617.60	11,171,559.38
1. 利息收入		21,335.08	12,691.80
其中：存款利息收入	6.4.3.11	21,335.08	12,691.80
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）		2,484,882.93	4,067,807.18
其中：股票投资收益	6.4.3.12	1,449,276.27	3,220,570.67

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		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	1,035,606.66	847,236.51
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.3.18	9,005,171.91	7,364,015.57
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-94,663.93	-319,281.46
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.19	65,891.61	46,326.29
<b>减：二、费用</b>		1,080,082.29	848,707.83
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	633,228.08	459,566.38
2. 托管费	6.4.6.2.2	158,307.00	114,891.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	10,770.27	15,213.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.21	277,776.94	259,036.53
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		10,402,535.31	10,322,851.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		10,402,535.31	10,322,851.55

### 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	87,946,838.33	24,525,092.27	112,471,930.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	10,402,535.31	10,402,535.31
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)	18,396,296.89	5,487,897.95	23,884,194.84
其中：1. 基金申购款	62,127,005.09	18,803,035.47	80,930,040.56



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，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(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。

### 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 2014年6月30日
活期存款	11,391,838.17
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	11,391,838.17

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	111,251,791.18	138,390,457.51	27,138,666.33
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
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	111,251,791.18	138,390,457.51	27,138,666.33

#### 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

本基金于本期末无买入返售金融资产。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,067.59
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,067.59

## 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	103,595.22
合计	103,595.22

## 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 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,364.66
预提费用	168,603.31
合计	181,967.97

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,946,838.33	87,946,838.33
本期申购	62,127,005.09	62,127,005.09

本期赎回(以“-”号填列)	-43,730,708.20	-43,730,708.20
本期末	106,343,135.22	106,343,135.22

#### 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	4,257,722.03	20,267,370.24	24,525,092.27
本期利润	1,397,363.40	9,005,171.91	10,402,535.31
本期基金份额交易产生的变动数	906,738.18	4,581,159.77	5,487,897.95
其中：基金申购款	3,060,053.11	15,742,982.36	18,803,035.47
基金赎回款	-2,153,314.93	-11,161,822.59	-13,315,137.52
本期已分配利润	-437,546.23	-	-437,546.23
本期末	6,124,277.38	33,853,701.92	39,977,979.30

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	21,254.10
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	80.98
合计	21,335.08

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	6,904,614.59
减：卖出股票成本总额	5,455,338.32
买卖股票差价收入	1,449,276.27

#### 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 贵金属投资收益**

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

**6.4.3.16 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具收益。

**6.4.3.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,035,606.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,035,606.66

**6.4.3.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,005,171.91
——股票投资	9,005,171.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,005,171.91

**6.4.3.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	60,286.83
其他	5,604.78
合计	65,891.61

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。

**6.4.3.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,770.27
银行间市场交易费用	-
合计	10,770.27

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
指数使用费	97,965.48
银行汇划费	8,361.26
税收费用	2,608.21
其他	238.68
合计	277,776.94

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 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
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合资子公司

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、以下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

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	633,228.08	459,566.38
其中：支付销售机构的客户维护费	231,904.35	176,032.47

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	158,307.00	114,891.57

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

###### 6.4.6.3 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。

## 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

## 6.4.6.5 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	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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	5,006,840.87	-	10,824,593.66	-
中国银行	6,384,997.30	21,254.10	4,582,425.31	12,691.80

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。

## 6.4.6.6 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。

## 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.7 利润分配情况

## 6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	14/1/20	14/1/17	0.0480	298,887.95	138,658.28	437,546.23	-
合计			0.0480	298,887.95	138,658.28	437,546.23	-

## 6.4.8 期末（2014 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2014年6月30日，本基金未持有信用类债券(2013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 2014 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

单位：人民币元

本期末 2014 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	11,391,838.17	-	-	-	11,391,838.17
交易性金融资产	-	-	-	138,390,457.51	138,390,457.51
应收证券清算款	-	-	-	266,979.10	266,979.10
应收利息	-	-	-	1,067.59	1,067.59
应收股利	-	-	-	141,170.52	141,170.52
应收申购款	8,961.52	-	-	557,051.73	566,013.25
其他资产	-	-	-	103,595.22	103,595.22
<b>资产总计</b>	<b>11,400,799.69</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>139,460,321.67</b>	<b>150,861,121.36</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	65,766.91	65,766.91
应付赎回款	-	-	-	4,144,348.74	4,144,348.74
应付管理人报酬	-	-	-	118,338.57	118,338.57
应付托管费	-	-	-	29,584.65	29,584.65
其他负债	-	-	-	181,967.97	181,967.97
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,540,006.84</b>	<b>4,540,006.84</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>11,400,799.69</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>134,920,314.83</b>	<b>146,321,114.52</b>
上年度末 2013 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	9,287,850.70	-	-	-	9,287,850.70
交易性金融资产	-	-	-	105,853,653.46	105,853,653.46
应收利息	-	-	-	307.74	307.74
应收股利	-	-	-	128,843.41	128,843.41
应收申购款	84,130.11	-	-	598,893.54	683,023.65
<b>资产总计</b>	<b>9,371,980.81</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>106,581,698.15</b>	<b>115,953,678.96</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	2,134,315.56	2,134,315.56
应付赎回款	-	-	-	1,088,259.01	1,088,259.01
应付管理人报酬	-	-	-	93,310.77	93,310.77
应付托管费	-	-	-	23,327.68	23,327.68
其他负债	-	-	-	142,535.34	142,535.34
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,481,748.36</b>	<b>3,481,748.36</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>9,371,980.81</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>103,099,949.79</b>	<b>112,471,930.60</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。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 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（2013 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 2014 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	5,006,840.87	-	-	5,006,840.87
交易性金融资产	138,390,457.51	-	-	138,390,457.51
应收股利	141,170.52	-	-	141,170.52
应收证券清算款	266,979.10	-	-	266,979.10
资产合计	143,805,448.00	-	-	143,805,448.00
以外币计价的负债				
应付证券清算款	65,766.91	-	-	65,766.91
负债合计	65,766.91	-	-	65,766.91
资产负债表外汇风险敞口净额	143,739,681.09	-	-	143,739,681.09
项目	上年度末 2013 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	7,707,760.91	-	-	7,707,760.91
交易性金融资产	105,853,653.46	-	-	105,853,653.46
应收股利	128,843.41	-	-	128,843.41
资产合计	113,690,257.78	-	-	113,690,257.78
以外币计价的负债				
应付证券清算款	2,134,315.56	-	-	2,134,315.56
负债合计	2,134,315.56	-	-	2,134,315.56
资产负债表外汇风险敞口净额	111,555,942.22	-	-	111,555,942.22

##### 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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 719	增加约 558
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 719	减少约 558

#### 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 2014年6月30日		上年度末 2013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	138,390,457.51	94.58	105,853,653.46	94.12
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
交易性金融资产-贵金属投资	-	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	138,390,457.51	94.58	105,853,653.46	94.12

#### 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:人民币万元)	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 710	增加约 536
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 710	减少约 536

#### 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	138,390,457.51	91.73
	其中: 普通股票	138,390,457.51	91.73
	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	11,391,838.17	7.55
8	其他各项资产	1,078,825.68	0.72
9	合计	150,861,121.36	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	138,390,457.51	94.58
合计	138,390,457.51	94.58

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

## 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	22,836,216.67	15.61
金融	22,790,816.00	15.58
工业	17,900,067.34	12.23
信息技术	17,771,922.77	12.15
医疗保健	14,976,009.59	10.24
能源	12,944,780.68	8.85
消费者常用品	11,039,839.02	7.54
公用事业	8,467,049.40	5.79
基础材料	8,177,763.97	5.59
电信服务	1,485,992.07	1.02
合计	138,390,457.51	94.58

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	US	1,039	372,122.51	0.25
2	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	608	354,188.64	0.24
3	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	1,570	342,443.31	0.23
4	Integrus Energy Group Inc	英迪斯能源集团公司	TEG UN	纽约交易所	US	765	334,801.23	0.23
5	Covidien Plc	Covidien 公共股份公司	COV UN	纽约交易所	US	603	334,580.28	0.23
6	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	1,012	323,847.21	0.22

7	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	631	318,707.60	0.22
8	QEP Resources	QEP 资源公司	QEP UN	纽约交易所	US	1,500	318,407.40	0.22
9	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	US	1,663	317,297.62	0.22
10	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	US	690	316,072.41	0.22
11	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	838	314,879.75	0.22
12	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne 公司	HP UN	纽约交易所	US	439	313,622.31	0.21
13	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克墨伦铜金矿公司	FCX UN	纽约交易所	US	1,386	311,264.00	0.21
14	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	US	588	310,555.93	0.21
15	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	US	481	309,622.56	0.21
16	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	US	842	309,181.65	0.21
17	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	US	825	309,132.05	0.21
18	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	US	508	309,092.80	0.21
19	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	US	1,558	307,137.44	0.21
20	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	US	885	307,001.95	0.21
21	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	US	1,202	306,032.64	0.21
22	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	US	1,496	304,579.84	0.21
23	Transocean Ltd	Transocean 公司	RIG UN	纽约交易所	US	1,099	304,489.58	0.21
24	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	US	890	304,300.88	0.21
25	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	726	304,108.79	0.21
26	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际公司	RHI UN	纽约交易所	US	1,035	304,015.39	0.21
27	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	2,189	303,714.21	0.21
28	Joy Global Inc	久益环球股份	JOY UN	纽约交易所	US			

		有限公司				801	303,490.43	0.21
29	Noble Corp plc	Noble 股份有 限公司	NE UN	纽约交易所	US	1,469	303,330.82	0.21
30	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	344	303,176.51	0.21
31	CareFusion Corp.	CareFusion 公 司	CFN UN	纽约交易所	US	1,110	302,893.11	0.21
32	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	839	302,866.23	0.21
33	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	US	2,855	302,842.05	0.21
34	Windstream Holdings Inc	Windstream 控 股公司	WIN UQ	纳斯达克交 易所	US	4,938	302,609.96	0.21
35	Celgene Corp	Celgene 公司	CELG UQ	纳斯达克交 易所	US	572	302,246.21	0.21
36	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	US	1,167	301,142.52	0.21
37	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交 易所	US	2,135	300,819.62	0.21
38	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	1,339	300,544.10	0.21
39	Delta Air Lines	达美航空有限 公司	DAL UN	纽约交易所	US	1,261	300,416.12	0.21
40	Chevron Corp	雪佛龙德士古	CVX UN	纽约交易所	US	374	300,414.77	0.21
41	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	1,490	300,057.90	0.21
42	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源 公司	CNX UN	纽约交易所	US	1,057	299,616.69	0.20
43	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	US	556	299,538.98	0.20
44	First Solar Inc	福思第一太阳 能公司	FSLR UQ	纳斯达克交 易所	US	685	299,494.31	0.20
45	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	US	472	299,211.65	0.20
46	AT&T Inc	美国电话电报 集团	T UN	纽约交易所	US	1,375	299,149.14	0.20
47	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	US	447	298,875.27	0.20
48	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers 公 司	TRV UN	纽约交易所	US	516	298,657.65	0.20
49	H&R Block Inc	H&R Block 公 司	HRB UN	纽约交易所	US	1,448	298,638.21	0.20

50	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	1,574	298,379.67	0.20
51	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	525	298,149.31	0.20
52	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	US	519	297,520.06	0.20
53	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	1,095	297,519.87	0.20
54	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	US	1,800	297,475.57	0.20
55	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻探公司	DO UN	纽约交易所	US	974	297,424.01	0.20
56	Franklin Resources Inc	富兰克林资源公司	BEN UN	纽约交易所	US	835	297,158.09	0.20
57	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	1,092	296,973.51	0.20
58	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	892	296,752.25	0.20
59	CenturyLink Inc	CenturyLink 公司	CTL UN	纽约交易所	US	1,332	296,678.17	0.20
60	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公司	DNR UN	纽约交易所	US	2,609	296,332.01	0.20
61	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	US	408	296,094.89	0.20
62	Frontier Communications Corp	公民通信	FTR UQ	纳斯达克交易所	US	8,233	295,831.05	0.20
63	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	US	1,024	295,743.93	0.20
64	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	US	1,888	295,523.41	0.20
65	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	435	294,946.77	0.20
66	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约交易所	US	1,062	294,695.74	0.20
67	SCANA Corp	SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	890	294,663.13	0.20
68	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern 公司	KSU UN	纽约交易所	US	445	294,361.95	0.20
69	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克交易所	US	2,700	294,208.44	0.20
70	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	702	293,407.71	0.20
71	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	402	293,150.40	0.20

72	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	US	1,165	293,028.33	0.20
73	American Tower Corp A	美国发射塔公 司	AMT UN	纽约交易所	US	529	292,869.71	0.20
74	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德 里奇	SIAL UQ	纳斯达克交 易所	US	469	292,837.10	0.20
75	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	US	942	292,578.93	0.20
76	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	2,165	292,391.82	0.20
77	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	US	586	292,337.25	0.20
78	Allegion plc	Allegion 公司	ALLE UN	纽约交易所	US	838	292,244.71	0.20
79	Gannett Co Inc	甘乃特公司	GCI UN	纽约交易所	US	1,517	292,241.20	0.20
80	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股	ZMH UN	纽约交易所	US	457	292,036.62	0.20
81	Verizon Communications Inc	Verizon 通讯 股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	US	969	291,723.75	0.20
82	Noble Energy Inc	Noble 能源股 份有限公司	NBL UN	纽约交易所	US	612	291,676.68	0.20
83	Horton D.R. Inc	DR Horton 公 司	DHI UN	纽约交易所	US	1,925	291,128.96	0.20
84	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交 易所	US	597	290,919.15	0.20
85	Jabil Circuit Inc	捷普科技	JBL UN	纽约交易所	US	2,261	290,749.95	0.20
86	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	US	1,524	290,589.11	0.20
87	Simon Property Group	Simon Property 公司	SPG UN	纽约交易所	US	284	290,556.87	0.20
88	Salesforce.com	Salesforce.c om 股份有限 公司	CRM UN	纽约交易所	US	813	290,529.31	0.20
89	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries 公 司	NBR UN	纽约交易所	US	1,607	290,397.33	0.20
90	Macerich Co	Macerich 公 司	MAC UN	纽约交易所	US	707	290,364.48	0.20
91	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	US	817	290,249.60	0.20
92	Walgreen Co	沃尔格林	WAG UN	纽约交易所	US	636	290,084.09	0.20

93	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	897	290,081.88	0.20
94	Ryder System Inc	Ryder 系统公司	R UN	纽约交易所	US	535	289,970.08	0.20
95	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	708	289,599.01	0.20
96	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	433	289,487.89	0.20
97	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	851	289,395.53	0.20
98	Northeast Utilities	Northeast Utilities 公司	NU UN	纽约交易所	US	995	289,388.64	0.20
99	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	US	779	289,259.43	0.20
100	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	US	662	289,234.64	0.20
101	Keurig Green Mountain Inc	Keurig Green Mountain 公司	GMCN UQ	纳斯达克交易所	US	377	289,046.05	0.20
102	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price 公司	TROW UQ	纳斯达克交易所	US	556	288,762.96	0.20
103	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	801	288,705.25	0.20
104	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	391	288,689.38	0.20
105	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	US	480	288,394.04	0.20
106	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	US	572	288,309.38	0.20
107	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	US	569	288,302.67	0.20
108	Zoetis Inc	Zoetis 公司	ZTS UN	纽约交易所	US	1,452	288,295.84	0.20
109	Gilead Sciences Inc	Gilead 科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	565	288,222.69	0.20
110	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	1,247	288,027.21	0.20
111	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	US	1,046	287,874.62	0.20
112	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	448	287,856.53	0.20
113	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	US	948	287,851.36	0.20

114	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	US	387	287,521.88	0.20
115	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	US	1,417	287,275.15	0.20
116	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	701	287,123.92	0.20
117	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	US	513	287,073.34	0.20
118	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	US	972	287,005.23	0.20
119	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	US	1,286	286,907.28	0.20
120	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	400	286,843.54	0.20
121	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	US	615	286,635.88	0.20
122	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	2,191	286,601.48	0.20
123	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	US	743	286,543.53	0.20
124	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	US	745	286,535.59	0.20
125	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	US	372	286,471.41	0.20
126	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	US	932	286,319.07	0.20
127	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	2,385	286,298.09	0.20
128	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克 OMX 集团股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	US	1,203	285,858.23	0.20
129	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	US	833	285,837.00	0.20
130	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	US	1,223	285,719.48	0.20
131	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	2,631	285,718.50	0.20
132	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	US	1,436	285,649.15	0.20
133	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	453	285,634.14	0.20
134	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	1,137	285,355.97	0.20

135	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	US	529	285,318.50	0.19
136	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	1,157	285,178.71	0.19
137	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	US	462	284,970.01	0.19
138	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	US	735	284,905.40	0.19
139	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	US	1,498	284,802.04	0.19
140	Under Armour Inc A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	US	778	284,771.40	0.19
141	CVS Caremark Corp.	CVS 公司	CVS UN	纽约交易所	US	614	284,734.23	0.19
142	United States Steel Corp	美国钢铁	X UN	纽约交易所	US	1,775	284,388.57	0.19
143	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	US	601	284,363.34	0.19
144	Allergan Inc	爱力根	AGN UN	纽约交易所	US	273	284,241.27	0.19
145	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	813	284,226.50	0.19
146	Kraft Foods Group Inc.	Kraft Foods 集团公司	KRFT UQ	纳斯达克交易所	US	770	284,022.48	0.19
147	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	US	598	283,974.12	0.19
148	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	US	720	283,964.03	0.19
149	Brown-Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交易所	US	490	283,910.50	0.19
150	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	316	283,885.02	0.19
151	The Bank of New York Mellon Corp	纽约梅隆银行股份有限公司	BK UN	纽约交易所	US	1,231	283,877.15	0.19
152	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	1,086	283,848.85	0.19
153	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	US	645	283,831.13	0.19
154	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	649	283,634.67	0.19
155	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	793	283,528.59	0.19
156	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	1,171	283,441.90	0.19

157	Avago Technologies Ltd	安华高科技有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	US	639	283,353.24	0.19
158	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	US	959	283,343.70	0.19
159	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业	PCL UN	纽约交易所	US	1,021	283,318.60	0.19
160	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	US	680	283,292.14	0.19
161	Essex Property Trust	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	纽约交易所	US	249	283,290.85	0.19
162	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	963	283,162.75	0.19
163	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	US	457	283,095.00	0.19
164	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	US	567	283,068.05	0.19
165	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	US	620	282,900.82	0.19
166	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	US	556	282,571.03	0.19
167	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	US	929	282,539.47	0.19
168	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	US	2,953	282,531.35	0.19
169	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	US	720	282,457.82	0.19
170	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	447	282,345.96	0.19
171	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	US	460	282,321.23	0.19
172	AGL Resources	AGL Resources 公司	GAS UN	纽约交易所	US	833	282,044.29	0.19
173	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	1,323	281,974.95	0.19
174	DIRECTV	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	539	281,923.70	0.19
175	PPG Industries Inc	PPG 工业公司	PPG UN	纽约交易所	US	218	281,876.38	0.19
176	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	839	281,752.83	0.19
177	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	US	387	281,688.10	0.19
178	Perrigo Company plc	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	US			

						314	281,605.29	0.19
179	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	508	281,587.32	0.19
180	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	US	616	281,454.67	0.19
181	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交易所	US	1,803	281,331.12	0.19
182	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	496	281,283.37	0.19
183	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	US	1,145	281,234.64	0.19
184	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	143	281,200.19	0.19
185	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	US	822	281,000.34	0.19
186	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	US	1,788	280,970.81	0.19
187	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	629	280,737.87	0.19
188	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	US	318	280,692.46	0.19
189	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼	DIS UN	纽约交易所	US	532	280,651.85	0.19
190	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	932	280,469.97	0.19
191	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	517	280,341.32	0.19
192	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	US	531	280,091.64	0.19
193	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	309	280,049.00	0.19
194	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	698	279,968.52	0.19
195	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	US	938	279,967.04	0.19
196	General Motors Company	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	US	1,253	279,853.34	0.19
197	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	US	452	279,830.82	0.19
198	Peabody Energy Corp	博地能源公司	BTU UN	纽约交易所	US	2,781	279,763.82	0.19
199	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	US	1,301	279,687.46	0.19
200	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有	WYNN UQ	纳斯达克交	US			

		限公司		易所		219	279,679.46	0.19
201	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	US	731	279,486.88	0.19
202	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	712	279,450.82	0.19
203	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达克交易所	US	672	279,421.78	0.19
204	Biogen Idec Inc	生物基因	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	144	279,365.67	0.19
205	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	734	279,279.04	0.19
206	PETSMART Inc	PetSmart 股份有限公司	PETM UQ	纳斯达克交易所	US	759	279,264.52	0.19
207	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	US	1,643	279,211.97	0.19
208	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	US	1,267	279,160.35	0.19
209	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	US	714	279,137.52	0.19
210	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	US	442	279,106.14	0.19
211	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	US	538	279,083.50	0.19
212	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	US	576	279,020.13	0.19
213	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	US	683	278,868.77	0.19
214	Stanley Black & Decker	史丹利 Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	US	516	278,814.87	0.19
215	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	US	3,043	278,785.03	0.19
216	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	US	1,218	278,780.91	0.19
217	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	US	1,404	278,765.40	0.19
218	Legg Mason Inc	Legg Mason 公司	LM UN	纽约交易所	US	883	278,763.25	0.19
219	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	US	654	278,657.24	0.19
220	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	US	197	278,553.07	0.19
221	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合伙企业	DVA UN	纽约交易所	US	626	278,551.53	0.19
222	Costco Wholesale	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交	US			

	Corp			易所		393	278,462.68	0.19
223	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	US	1,068	278,355.63	0.19
224	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	US	387	278,259.27	0.19
225	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	US	354	278,185.81	0.19
226	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	US	293	278,149.45	0.19
227	JM Smucker Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	US	424	278,018.45	0.19
228	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	US	509	278,007.68	0.19
229	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	US	1,322	277,938.83	0.19
230	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	US	769	277,833.87	0.19
231	MeadWestvaco Corp	MeadWestvaco 公司	MWV UN	纽约交易所	US	1,020	277,769.39	0.19
232	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	382	277,766.68	0.19
233	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	US	877	277,678.45	0.19
234	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	1,082	277,610.64	0.19
235	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	US	298	277,560.44	0.19
236	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	901	277,516.26	0.19
237	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	US	1,299	277,499.16	0.19
238	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	828	277,447.47	0.19
239	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	468	277,412.03	0.19
240	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	US	485	277,372.84	0.19
241	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	952	277,351.00	0.19
242	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	US	725	277,326.69	0.19
243	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	US	1,450	277,282.08	0.19
244	PNC Finl Services	PNC 金融服务	PNC UN	纽约交易所	US			

	Group					506	277,240.86	0.19
245	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	US	641	277,062.12	0.19
246	Nielsen NV	尼尔森控股公司	NLSN UN	纽约交易所	US	930	277,007.05	0.19
247	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	559	276,976.11	0.19
248	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	US	380	276,756.64	0.19
249	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	US	187	276,747.47	0.19
250	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	484	276,741.38	0.19
251	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	US	431	276,535.63	0.19
252	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	US	566	276,509.29	0.19
253	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	US	503	276,494.65	0.19
254	AbbVie Inc.	AbbVie 公司	ABBV UN	纽约交易所	US	796	276,422.17	0.19
255	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	US	360	276,300.10	0.19
256	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	433	276,273.64	0.19
257	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	US	540	276,233.65	0.19
258	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	US	1,309	276,091.64	0.19
259	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	US	279	275,845.47	0.19
260	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	US	604	275,711.64	0.19
261	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	US	1,191	275,605.51	0.19
262	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	361	275,535.00	0.19
263	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	US	852	275,424.43	0.19
264	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	US	1,016	275,117.28	0.19
265	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店	FDO UN	纽约交易所	US	676	275,095.63	0.19
266	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交	US			

				易所		945	275,079.07	0.19
267	Cardinal Health Inc	Cardinal Health 公司	CAH UN	纽约交易所	US	652	275,037.05	0.19
268	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	US	1,700	274,882.49	0.19
269	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics 公司	DGX UN	纽约交易所	US	761	274,803.06	0.19
270	People's United Financial Inc	People's United 金融公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	2,944	274,787.00	0.19
271	Hospira Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	US	869	274,664.25	0.19
272	Lorillard Inc	Lorillard 股份有限公司	LO UN	纽约交易所	US	732	274,599.71	0.19
273	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	1,145	274,541.94	0.19
274	Kohl's Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约交易所	US	847	274,537.69	0.19
275	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	US	884	274,510.13	0.19
276	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	485	274,448.41	0.19
277	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	US	488	274,434.57	0.19
278	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	US	978	274,395.19	0.19
279	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	US	470	274,346.58	0.19
280	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	US	1,181	274,308.74	0.19
281	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	1,189	273,972.19	0.19
282	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	2,023	273,960.99	0.19
283	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	588	273,943.33	0.19
284	TECO Energy Inc	TECO 能源	TE UN	纽约交易所	US	2,409	273,912.32	0.19
285	The Priceline Group Inc	Priceline.com 股份有限公司	PCLN UQ	纳斯达克交易所	US	37	273,867.28	0.19
286	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	711	273,633.78	0.19

287	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	416	273,617.48	0.19
288	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	2,398	273,546.84	0.19
289	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,789	273,532.88	0.19
290	WellPoint Inc	WellPoint 公司	WLP UN	纽约交易所	US	413	273,448.46	0.19
291	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	564	273,311.31	0.19
292	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	1,238	273,227.76	0.19
293	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	US	349	273,204.44	0.19
294	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	US	1,496	273,192.20	0.19
295	Twenty-First Century Fox, Inc	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	US	1,263	273,150.17	0.19
296	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	US	2,560	273,125.25	0.19
297	Actavis plc	Actavis 公司	ACT UN	纽约交易所	US	199	273,104.03	0.19
298	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	1,615	273,062.49	0.19
299	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	US	659	272,718.80	0.19
300	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	US	613	272,691.48	0.19
301	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	1,095	272,659.18	0.19
302	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	US	766	272,649.64	0.19
303	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	1,247	272,605.40	0.19
304	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	US	415	272,525.66	0.19
305	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	703	272,501.36	0.19
306	Forest Laboratories	森林实验室	FRX UN	纽约交易所	US	447	272,279.86	0.19
307	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	US	975	272,233.71	0.19
308	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	US	397	272,210.21	0.19

309	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	US	1,021	272,136.62	0.19
310	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	US	404	272,112.99	0.19
311	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	US	311	272,083.52	0.19
312	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	US	1,090	271,816.55	0.19
313	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	1,406	271,722.78	0.19
314	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	2,068	271,657.20	0.19
315	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	US	351	271,530.63	0.19
316	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	969	271,214.25	0.19
317	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	US	631	271,186.81	0.19
318	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	100	271,092.37	0.19
319	C.R. Bard Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	US	308	271,012.87	0.19
320	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	US	452	270,792.36	0.19
321	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	US	804	270,790.63	0.19
322	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	US	486	270,768.12	0.19
323	L Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LB UN	纽约交易所	US	750	270,692.44	0.18
324	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	2,862	270,655.15	0.18
325	Grainger W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	US	173	270,653.73	0.18
326	Zions Bancorp (UT)	活德	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	1,492	270,533.94	0.18
327	Waters Corp	Zions 银行	WAT UN	纽约交易所	US	421	270,533.94	0.18
328	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	US	669	270,435.86	0.18
329	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	US	938	270,328.93	0.18
330	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交	US			

				易所		1,527	270,021.66	0.18
331	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	US	419	269,944.81	0.18
332	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	135	269,771.36	0.18
333	Schwab Charles Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	US	1,628	269,751.30	0.18
334	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	408	269,686.08	0.18
335	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	US	428	269,660.00	0.18
336	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	370	269,587.39	0.18
337	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	US	603	269,578.66	0.18
338	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	873	269,429.14	0.18
339	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	717	269,369.71	0.18
340	Kimco Realty Corp	Kimco Realty 公司	KIM UN	纽约交易所	US	1,905	269,350.51	0.18
341	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	US	379	269,219.15	0.18
342	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	US	1,042	269,142.91	0.18
343	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	US	692	269,089.02	0.18
344	McDonald's Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	US	434	269,007.55	0.18
345	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	US	365	268,661.70	0.18
346	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	4,438	268,419.22	0.18
347	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	US	374	268,313.76	0.18
348	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	US	3,504	268,199.08	0.18
349	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	US	1,963	268,130.41	0.18
350	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	US	1,105	268,078.42	0.18
351	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	US	639	268,059.16	0.18
352	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	US			

						538	267,994.31	0.18
353	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	US	559	267,827.26	0.18
354	Public Storage	Public Storage 公司	PSA UN	纽约交易所	US	254	267,787.70	0.18
355	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	658	267,730.11	0.18
356	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	US	1,566	267,668.21	0.18
357	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	US	498	267,648.65	0.18
358	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	US	338	267,484.12	0.18
359	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交易所	US	1,463	267,165.90	0.18
360	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	600	267,129.96	0.18
361	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	1,250	267,108.43	0.18
362	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	US	903	266,909.20	0.18
363	Fossil Group Inc	化石集团	FOSL UQ	纳斯达克交易所	US	415	266,882.62	0.18
364	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	288	266,864.16	0.18
365	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	547	266,823.31	0.18
366	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	US	1,392	266,790.33	0.18
367	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	US	817	266,673.73	0.18
368	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	US	699	266,564.03	0.18
369	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	US	596	266,375.88	0.18
370	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	US	805	265,877.25	0.18
371	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	US	232	265,805.39	0.18
372	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	US	258	265,798.01	0.18
373	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交易所	US	603	265,608.81	0.18

374	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	US	531	265,291.51	0.18
375	Health Care REIT Inc	Health Care REIT 公司	HCN UN	纽约交易所	US	688	265,290.03	0.18
376	Bemis Co Inc	Bemis 公司	BMS UN	纽约交易所	US	1,060	265,183.22	0.18
377	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	834	264,679.43	0.18
378	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约交易所	US	830	264,635.62	0.18
379	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	US	526	264,573.48	0.18
380	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	807	264,551.70	0.18
381	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	585	264,447.04	0.18
382	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	899	264,288.72	0.18
383	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	880	264,279.99	0.18
384	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	712	264,249.47	0.18
385	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	US	386	264,145.36	0.18
386	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	1,257	264,041.14	0.18
387	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	US	936	263,820.74	0.18
388	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	910	263,715.16	0.18
389	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	US	741	263,705.56	0.18
390	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	US	806	263,579.18	0.18
391	General Growth Properties Inc	通用增长物业公司	GGP UN	纽约交易所	US	1,818	263,537.22	0.18
392	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	US	623	263,493.78	0.18
393	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	617	263,195.93	0.18
394	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	US	322	263,182.82	0.18
395	Broadcom Corp A	Broadcom 公	BRCM UQ	纳斯达克交	US			

		司		易所		1, 152	263, 107. 51	0. 18
396	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	US	506	262, 514. 87	0. 18
397	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 公司	CMG UN	纽约交易所	US	72	262, 482. 88	0. 18
398	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	2, 116	262, 469. 59	0. 18
399	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	US	169	262, 451. 38	0. 18
400	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	US	1, 167	262, 225. 20	0. 18
401	Assurant Inc	Assurant 公司	AIZ UN	纽约交易所	US	649	261, 752. 11	0. 18
402	Textron Inc	德事隆公司	TXT UN	纽约交易所	US	1, 111	261, 741. 28	0. 18
403	Genworth Financial Inc	Genworth 金融公司	GNW UN	纽约交易所	US	2, 443	261, 544. 45	0. 18
404	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	549	261, 380. 91	0. 18
405	Safeway Inc	美国西夫韦股份有限公司	SWY UN	纽约交易所	US	1, 237	261, 362. 21	0. 18
406	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	US	631	261, 247. 83	0. 18
407	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	US	540	261, 116. 22	0. 18
408	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	US	662	261, 089. 15	0. 18
409	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	869	260, 976. 49	0. 18
410	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	US	1, 037	260, 960. 55	0. 18
411	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	2, 958	260, 805. 75	0. 18
412	Graham Holdings Co	格雷厄姆控股公司	GHC UN	纽约交易所	US	59	260, 684. 85	0. 18
413	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	US	1, 256	260, 276. 24	0. 18
414	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	US	959	260, 272. 61	0. 18
415	Avon Products	雅芳	AVP UN	纽约交易所	US	2, 895	260, 238. 52	0. 18

416	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	US	263	260,091.10	0.18
417	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	US	1,081	259,927.99	0.18
418	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	487	259,878.95	0.18
419	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	US	735	259,761.37	0.18
420	Discovery Communications Inc	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	568	259,593.03	0.18
421	Alliance Data Systems Corp	Alliance Data Systems 公司	ADS UN	纽约交易所	US	150	259,571.25	0.18
422	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	457	259,391.28	0.18
423	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	1,014	259,290.31	0.18
424	McGraw Hill Financial Inc	麦格希公司	MHFI UN	纽约交易所	US	507	259,009.56	0.18
425	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	US	1,306	258,986.00	0.18
426	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	US	3,961	258,822.58	0.18
427	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath&Beyond 公司	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	733	258,783.94	0.18
428	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	655	258,771.69	0.18
429	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	US	304	258,758.22	0.18
430	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	US	590	258,539.43	0.18
431	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	US	492	258,490.70	0.18
432	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	US	203	258,434.40	0.18
433	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	US	1,010	258,329.61	0.18
434	News Corporation	美国新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	2,340	258,292.08	0.18
435	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	US	541	258,137.96	0.18
436	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	US	3,285	258,106.58	0.18
437	Wisconsin Energy	威斯康星能源	WEC UN	纽约交易所	US			

	Corp	公司				894	258,088.30	0.18
438	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	812	257,597.55	0.18
439	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	US	384	257,318.96	0.18
440	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	US	1,203	257,287.21	0.18
441	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	US	1,209	257,231.46	0.18
442	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	US	535	257,217.19	0.18
443	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	US	562	257,092.90	0.18
444	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	US	300	256,977.84	0.18
445	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	US	1,584	256,710.57	0.18
446	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	843	256,487.77	0.18
447	Target Corp	Target 百货公司	TGT UN	纽约交易所	US	719	256,362.87	0.18
448	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	US	809	256,048.53	0.17
449	Pentair PLC	Pentair 股份有限公司	PNR UN	纽约交易所	US	577	256,037.94	0.17
450	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	US	840	255,781.74	0.17
451	Starwood Hotel & Resort World	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	US	514	255,596.42	0.17
452	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	US	666	255,085.86	0.17
453	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	880	254,858.82	0.17
454	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	841	254,844.36	0.17
455	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	US	808	254,787.45	0.17
456	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	US	718	254,548.47	0.17
457	Macy's Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	US	712	254,173.64	0.17
458	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	US	371	254,154.57	0.17
459	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	US			

						1,005	254,082.64	0.17
460	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	US	470	253,901.44	0.17
461	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	US	549	253,577.99	0.17
462	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	349	253,384.61	0.17
463	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	100	253,372.30	0.17
464	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	US	325	253,076.97	0.17
465	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	US	645	252,995.45	0.17
466	Rowan Cos Plc	Rowan 公司	RDC UN	纽约交易所	US	1,286	252,646.15	0.17
467	Phillips 66	Phillips 66 公司	PSX UN	纽约交易所	US	510	252,383.55	0.17
468	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	US	679	252,336.17	0.17
469	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	3,782	252,245.60	0.17
470	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	US	1,668	251,850.84	0.17
471	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	US	713	251,635.25	0.17
472	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	649	250,890.70	0.17
473	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	US	76	250,752.69	0.17
474	Patterson Cos Inc	Patterson Cos 公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,031	250,633.14	0.17
475	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	US	144	250,269.32	0.17
476	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	US	4,262	250,169.65	0.17
477	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	US	1,169	250,015.58	0.17
478	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	1,549	249,894.62	0.17
479	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	1,049	249,329.11	0.17
480	AMETEK Inc	阿美特克股份	AME UN	纽约交易所	US			

		有限公司				774	248,971.33	0.17
481	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	US	192	248,919.65	0.17
482	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	US	544	248,557.37	0.17
483	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	US	1,193	248,542.23	0.17
484	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	567	247,518.84	0.17
485	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	565	247,480.08	0.17
486	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	US	1,060	245,552.10	0.17
487	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易所	US	1,136	245,543.97	0.17
488	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	511	245,458.39	0.17
489	Accenture plc	Accenture 公司	ACN UN	纽约交易所	US	493	245,214.43	0.17
490	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制药公司	ALXN UQ	纳斯达克交易所	US	254	244,189.25	0.17
491	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	US	606	243,999.37	0.17
492	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	US	218	243,139.34	0.17
493	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	US	454	242,883.63	0.17
494	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	US	787	242,596.91	0.17
495	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所公司 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	US	208	241,750.90	0.17
496	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	US	435	237,268.89	0.16
497	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	1,122	236,028.67	0.16
498	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	US	828	235,723.37	0.16
499	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	US	921	227,802.50	0.16
500	Google Inc A	谷歌 C 级股份公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	US	39	140,296.95	0.10
501	Google Inc C	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	39	138,043.73	0.09

502	Washington Prime Group Inc	Washington Prime Group 公司	WPG UN	纽约交易所	US	0.5	57.65	0.00
-----	----------------------------	---------------------------	--------	-------	----	-----	-------	------

## 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	Essex Property Trust Inc	ESS UN	295,649.64	0.26
2	Tractor Supply Co	TSCO UQ	286,578.00	0.25
3	Cimarex Energy Co	XEC UN	275,806.16	0.25
4	Avago Technologies Ltd	AVGO UQ	270,936.02	0.24
5	Keurig Green Mountain Inc	GMCR UQ	254,988.11	0.23
6	Under Armour Inc A	UA UN	248,578.91	0.22
7	Navient Corp	NAVI UQ	234,549.79	0.21
8	The ADT Corp.	ADT UN	140,991.48	0.13
9	Best Buy Co Inc	BBY UN	138,006.10	0.12
10	Coach Inc	COH UN	135,043.61	0.12
11	Whole Foods Market Inc	WFM UQ	132,314.63	0.12
12	PETSMART Inc	PETM UQ	124,998.78	0.11
13	National Oilwell Varco Inc	NOV UN	123,767.73	0.11
14	Transocean Ltd	RIG UN	116,987.69	0.10
15	Staples Inc	SPLS UQ	115,822.67	0.10
16	Carmax Inc	KMX UN	113,736.99	0.10
17	Bed Bath & Beyond Inc	BBBY UQ	113,087.94	0.10
18	Diamond Offshore Drilling	DO UN	111,850.58	0.10
19	Noble Corp plc	NE UN	107,914.95	0.10
20	E*TRADE Financial Corp	ETFC UQ	103,803.77	0.09

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	Intl Game Technology	IGT UN	282,957.90	0.25
2	Cliffs Natural Resources	CLF UN	265,396.72	0.24

	Inc			
3	Life Technologies Corp	LIFE UQ	207,965.95	0.18
4	WPX Energy Inc.	WPX UN	207,456.91	0.18
5	Newfield Exploration Co	NFX UN	161,522.71	0.14
6	Forest Laboratories	FRX UN	145,919.86	0.13
7	Nabors Industries Ltd	NBR UN	141,989.55	0.13
8	Allergan Inc	AGN UN	136,268.57	0.12
9	Electronic Arts Inc	EA UQ	115,879.71	0.10
10	Pepco Holdings Inc	POM UN	99,613.88	0.09
11	Alcoa Inc	AA UN	98,177.15	0.09
12	Anadarko Petroleum Corp	APC UN	95,604.18	0.09
13	SLM Corp	SLM UQ	87,022.54	0.08
14	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	82,027.48	0.07
15	EOG Resources	EOG UN	81,923.92	0.07
16	SanDisk Corp	SNDK UQ	79,928.75	0.07
17	LSI Corporation	LSI UQ	78,061.07	0.07
18	ConocoPhillips	COP UN	73,621.86	0.07
19	Molson Coors Brewing Co B	TAP UN	70,382.42	0.06
20	Apache Corp	APA UN	69,575.97	0.06

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	28,986,970.46
卖出收入（成交）总额	6,904,614.59

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	266,979.10
3	应收股利	141,170.52
4	应收利息	1,067.59
5	应收申购款	566,013.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	103,595.22
8	其他	-
9	合计	1,078,825.68

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

**7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

**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
6143	17,311.27	6,749,566.66	6.35%	99,593,568.56	93.65%

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	213,552.45	0.20%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	大成标普 500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成标普 500	0
	合计	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	87,946,838.33
本报告期基金总申购份额	62,127,005.09
减：本报告期基金总赎回份额	43,730,708.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	106,343,135.22

## § 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

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

基金管理人于2014年1月25日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公

告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

### 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（特殊普通合伙）。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

本报告期内，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	35,421,861.37	100.00%	10,770.27	100.00%	-

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务

评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、公司作为管理人负责选择代理各投资组合证券买卖的境外券商，具体选择标准如下：

(一) 具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；

(二) 资历雄厚，信誉良好；

(三) 财务状况良好，经营行为规范；

(四) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度(包括但不限于公平交易制度及保密制度)，能满足各投资组合运作高度保密的要求；

(五) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为各投资组合提供宏观经济、行业情况、个股分析、市场研究等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据各投资组合投资的特定要求，提供专题研究报告；

(六) 具备各投资组合运作所需的交易执行能力。能够准确、及时、高质量完成各投资组合下达的交易指令。

(七) 具备各投资组合运作所需的后台清算执行能力。能及时、高效处理交易清算、证券交收等后台清算业务。

(八) 能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

(九) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每半年 15 个交易日内，汇总上半年境外券商综合服务评价结果，作为当次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，供交易员在交易时进行券商选择。

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、齐鲁证券、民生证券、万联证券、东海证券、万和证券、华鑫证券、东吴证券、国海证券、华林证券、英大证券、民族证券。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金无退租或新增的境内交易单元，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

无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为开放式基金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	2014/1/4
2	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	2014/1/16
3	大成标普 500 等权重指数基金分红公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/1/16
4	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/1/22
5	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/1/25
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	2014/2/13
7	关于大成基金管理有限公司北京理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/3/19
8	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2013 年年度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/3/29
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/3/29
10	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统中定期定额投资起点金额的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/4/8
11	大成基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/4/11
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	2014/4/16
13	关于增加中国民族证券有限责任公司为开放式基金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	2014/4/17
14	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/4/21
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/5/8
16	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（2014 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/5/8
17	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/5/22

18	关于增加杭州数米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	2014/6/5
19	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告	中国证监会指定报刊及 本公司网站	2014/6/30

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

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

#### 12.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的住所。

#### 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  
2014 年 8 月 28 日