
大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2014 年年度报告
2014 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§ 8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	68
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	70
8.7 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.....	70
8.8 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.....	70

8.9 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	70
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	70
8.11 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 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	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 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	75,142,701.26 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	刘卓	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行股份有限公司托管及投资者服务部

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	12,629,863.89	5,397,706.62	79,108.71
本期利润	14,595,324.62	23,522,175.77	17,108,874.66
加权平均基金份额本期利润	0.1489	0.2737	0.1343
本期加权平均净值利润率	11.06%	23.67%	14.00%
本期基金份额净值增长率	11.91%	27.26%	13.82%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	13,996,093.01	4,220,695.34	-1,576,241.73
期末可供分配基金份额利润	0.1863	0.0480	-0.0162
期末基金资产净值	107,162,735.88	112,471,930.60	97,933,873.07

期末基金份额净值	1.426	1.279	1.005
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	43.14%	27.90%	0.50%

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）。

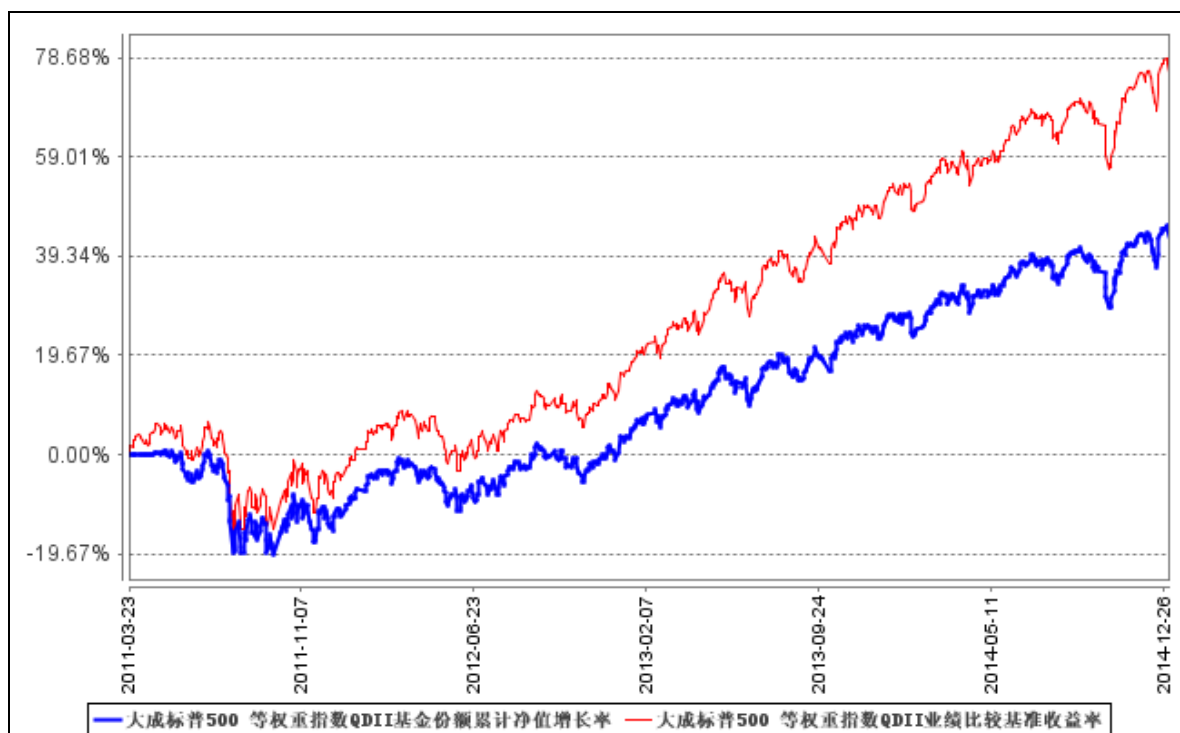
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	4.85%	0.86%	6.11%	0.88%	-1.26%	-0.02%
过去六个月	3.63%	0.72%	5.37%	0.75%	-1.74%	-0.03%
过去一年	11.91%	0.67%	14.49%	0.70%	-2.58%	-0.03%
过去三年	62.10%	0.76%	83.41%	0.80%	-21.31%	-0.04%
自基金合同生效起至今	43.14%	1.03%	75.81%	1.10%	-32.67%	-0.07%

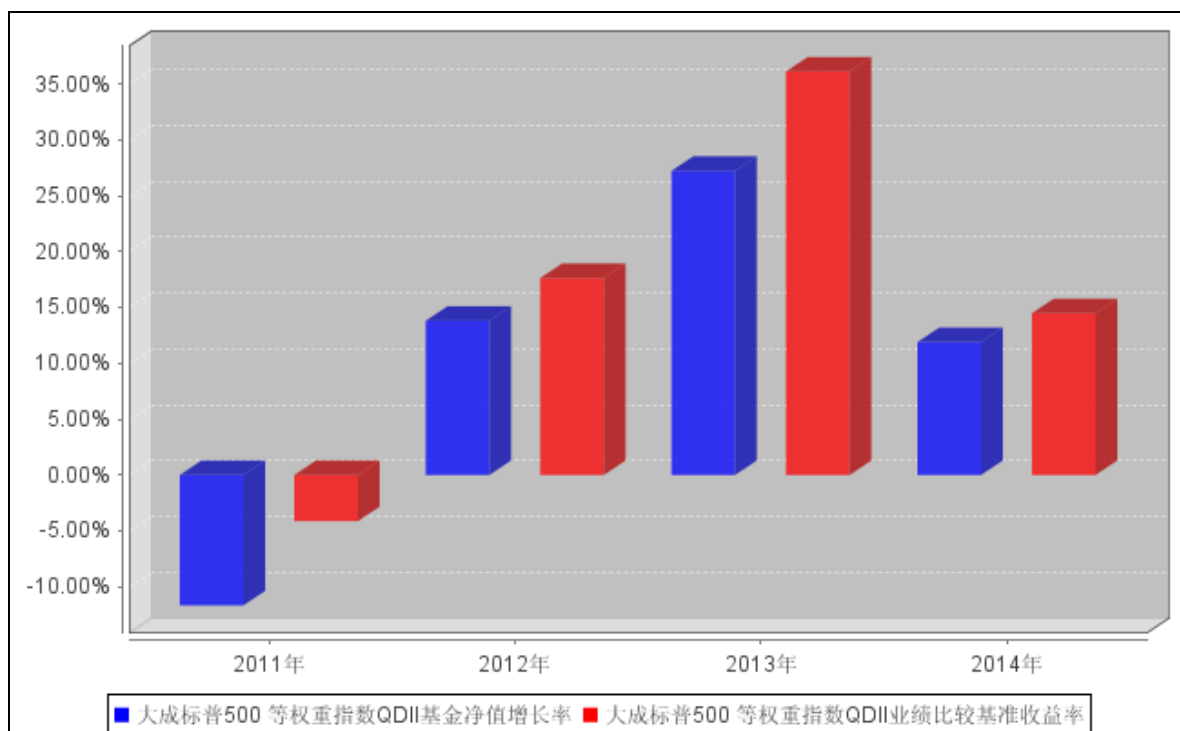
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2014	0.048	298,887.95	138,658.28	437,546.23	
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
合计	0.048	298,887.95	138,658.28	437,546.23	

§ 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12月31日，本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金：大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金，2只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克100指数证券投资基金及40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、大成景恒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、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、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、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）。

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日起担任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起担任大成纳斯达克100指数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等权重指数型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，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基

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

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对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进行分析。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些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 23 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。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 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，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。

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，全球金融市场的表现相对稳定，但全球宏观经济增长速度相对放缓，而美国是全球经济增长的主要亮点。

从欧洲方面来看，金融体系虽然保持了较好的稳定性，但其宏观经济表现逊色，不断摇摆于微弱增长与轻微衰退之间；同期，日本经济也出现了增长乏力的状况。因此，美国成为了 2014 年全球经济增长的主要亮点。

2014 年 1 季度，美国本土遭遇近二十年来最严寒天气，其间社会经济活动减弱，导致当季度经济活动减弱，宏观经济数据也受短暂影响，1 季度 GDP 环比增长率实现了负增长。但是，天气

对宏观经济的影响是短暂的，当天气完全恢复正常，美国宏观经济也出现了爆发式的增长，各项宏观经济屡创金融危机之后的最佳水平。如果综合考量 2 季度与 3 季度的 GDP 年化季环比增长率数据，则本年 2 季度与 3 季度已经是 2003 年第四季度以来的最强连续两季度增速，这说明了美国的宏观经济增长已入佳境。

2014 年 4 季度以来，国际原油价格出现了快速且大幅度的下跌。油价的下跌等效于提高居民实际收入，未来有望会进一步提振消费，促进经济增长。

2014 年初，美国联邦储备委员会更换了主席，新任主席耶伦女士被市场公认为是鸽派，对宽松货币政策持支持立场。虽然本年美联储逐步缩减并最终结束了量化宽松政策，但由于宏观经济的强劲增长，货币政策的逐步收紧并没有改变美股的上涨趋势。

综合来看，由于美国宏观经济的强劲表现，本基金所跟踪的标普 500 等权重指数创出历史新高。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 14.49%，美元兑人民币中间价上涨 0.36%，经汇率调整后的目标指数上涨 14.91%。在本报告期内，本基金净值上涨 11.91%，低于经汇率调整后的目标指数 2.99%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 0.78%，日均偏差绝对值为 0.040%，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 1.426 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.91%，同期业绩比较基准收益率为 14.49%，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 2015 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房地产市场的进一步复苏。美国宏观经济的强劲增长会进一步推动劳动力市场的逐步恢复，劳动力市场的复苏会继续推动消费的增长，而消费的增长又会进一步推动劳动力市场的复苏，这种良好的正向循环机制有望在 2015 年得以持续加强。

在强劲的宏观经济增长的推动下，本指数成分股企业盈利也有望保持强劲增长。当前标普 500 指数的动态市盈率处于 16 至 17 倍之间，仍然处于历史平均区间内。未来指数盈利的持续增加有望推动标普 500 指数持续上涨。

由于美元对全球主要货币的持续升值，人民币兑美元汇率改变了多年以来人民币持续升值的趋势，而出现了人民币兑美元贬值的情形。由于本基金资产中的绝大部分是以美元计价的美国股票及少量美元存款，因此美元兑人民币的升值有利于本基金净值的表现。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。本年度内，深圳辖区基金公司按照监管部门要求深入开展各项自查工作，公司以此为契机，在强化将风险控制放在各项工作之首的风控理念基础上，力求将风控意识深入到每个业务条线。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险数量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

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

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

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部

门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内大成标普 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。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成标普 500 等权重指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的大成标普 500 等权重指数证券投资基金（以下简称“大成标普 500 等权重指数基金”）的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是大成标普 500 等权重指数基金的基金管理人大成基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进

	行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述大成标普 500 等权重指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了大成标普 500 等权重指数基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2015 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,140,744.45	9,287,850.70
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	100,813,207.70	105,853,653.46
其中：股票投资		100,813,207.70	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,679,332.89	-
应收利息	7.4.7.5	882.47	307.74
应收股利		131,104.65	128,843.41
应收申购款		191,659.35	683,023.65

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		109,956,931.51	115,953,678.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,134,315.56
应付赎回款		2,330,061.59	1,088,259.01
应付管理人报酬		93,503.94	93,310.77
应付托管费		23,375.99	23,327.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	347,254.11	142,535.34
负债合计		2,794,195.63	3,481,748.36
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	75,142,701.26	87,946,838.33
未分配利润	7.4.7.10	32,020,034.62	24,525,092.27
所有者权益合计		107,162,735.88	112,471,930.60
负债和所有者权益总计		109,956,931.51	115,953,678.96

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.426 元，基金份额总额 75,142,701.26 份。

7.2 利润表

公告主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
一、收入		16,828,409.75	25,363,118.94
1. 利息收入		37,687.01	28,114.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	37,687.01	28,114.03
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）		14,957,914.78	7,530,834.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,683,498.80	5,760,270.06
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	2,274,415.98	1,770,564.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,965,460.73	18,124,469.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-277,508.14	-410,615.17
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	144,855.37	90,316.47
减：二、费用		2,233,085.13	1,840,943.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,316,479.25	995,559.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	329,119.78	248,889.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	31,711.33	29,306.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	555,774.77	567,187.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,595,324.62	23,522,175.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,595,324.62	23,522,175.77

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	14,595,324.62	14,595,324.62
三、本期基金份额交易	-12,804,137.07	-6,662,836.04	-19,466,973.11

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	92,729,943.91	30,276,816.64	123,006,760.55
2. 基金赎回款	-105,534,080.98	-36,939,652.68	-142,473,733.66
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)	-	-437,546.23	-437,546.23
五、期末所有者权益(基金净值)	75,142,701.26	32,020,034.62	107,162,735.88
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	23,522,175.77	23,522,175.77
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)	-9,462,099.49	477,981.25	-8,984,118.24
其中: 1. 基金申购款	95,315,537.51	14,783,328.50	110,098,866.01
2. 基金赎回款	-104,777,637.00	-14,305,347.25	-119,082,984.25
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)	87,946,838.33	24,525,092.27	112,471,930.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

罗登攀

肖剑

范瑛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成标普 500 等权重指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 1876 号《关于核准大成标普 500 等权重指数证券投资

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2015 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期间无须说明其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	6,140,744.45	9,287,850.70
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	6,140,744.45	9,287,850.70

注：于 2014 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 391,426.98 元，折合人民币 2,395,141.70 元(2013 年 12 月 31 日：活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,264,209.83 元，折合人民币 7,707,760.91 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,714,252.55	100,813,207.70	20,098,955.15
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	80,714,252.55	100,813,207.70	20,098,955.15
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,720,159.04	105,853,653.46	18,133,494.42
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	87,720,159.04	105,853,653.46	18,133,494.42
----	---------------	----------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	882.47	307.74
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	882.47	307.74

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
预提信息披露费	300,000.00	100,000.00
预提审计费	40,000.00	40,000.00
应付赎回费	7,254.11	2,535.34
合计	347,254.11	142,535.34

7.4.7.9 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 12 月 31 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	92,729,943.91	92,729,943.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-105,534,080.98	-105,534,080.98
本期末	75,142,701.26	75,142,701.26

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,257,722.03	20,267,370.24	24,525,092.27
本期利润	12,629,863.89	1,965,460.73	14,595,324.62
本期基金份额交易产生的变动数	-2,453,946.68	-4,208,889.36	-6,662,836.04
其中：基金申购款	5,436,772.59	24,840,044.05	30,276,816.64
基金赎回款	-7,890,719.27	-29,048,933.41	-36,939,652.68
本期已分配利润	-437,546.23	-	-437,546.23
本期末	13,996,093.01	18,023,941.61	32,020,034.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	37,482.42	27,529.21
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	204.59	584.82
合计	37,687.01	28,114.03

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	60,618,577.24	52,657,409.88
卖出股票成本总额	47,935,078.44	46,897,139.82
买卖股票差价收入	12,683,498.80	5,760,270.06

7.4.7.13 基金投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资收益。

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,274,415.98	1,770,564.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,274,415.98	1,770,564.40

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
1. 交易性金融资产	1,965,460.73	18,124,469.15
——股票投资	1,965,460.73	18,124,469.15
——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	1,965,460.73	18,124,469.15

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
基金赎回费收入	139,250.59	90,228.25
其他	5,604.78	88.22
合计	144,855.37	90,316.47

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
交易所市场交易费用	31,711.33	29,306.72
银行间市场交易费用	-	-
合计	31,711.33	29,306.72

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014 年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
信息披露费	300,000.00	300,000.00
指数使用费	201,560.70	206,959.50
审计费用	40,000.00	40,000.00
银行划款手续费	11,367.18	11,751.48
其他	2,846.89	8,476.15
合计	555,774.77	567,187.13

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数数据使用费及标的指数许可使用费，其中标的指数数据使用费按每年 8,000 美元收取，按年支付；标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年 25,000.00 美元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 16 日宣告 2014 年度第 1 次分红，向截至 2015 年 1 月 20 日止在本基金注册登记人大成基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1870 元。

7.4.9 关联方关系

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

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

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,316,479.25	995,559.50
其中：支付销售机构的客户维护费	483,146.16	369,879.41

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	329,119.78	248,889.82

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.3.1 各关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.4 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	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,745,638.00	37,482.42	1,580,089.79	27,529.21
中银香港	2,395,106.45	-	7,707,760.91	-

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

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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	2014 年 1 月 20 日	2014 年 1 月 17 日	0.0480	298,887.95	138,658.28	437,546.23	
合计	-	-	0.0480	298,887.95	138,658.28	437,546.23	

7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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

7.4.13.2 信用风险

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

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的活期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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2013 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 12 月 31 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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,140,744.45	-	-	-	6,140,744.45
交易性金融资产	-	-	-	100,813,207.70	100,813,207.70
应收利息	-	-	-	882.47	882.47
应收股利	-	-	-	131,104.65	131,104.65
应收申购款	19,623.66	-	-	172,035.69	191,659.35
应收证券清算款	-	-	-	2,679,332.89	2,679,332.89
资产总计	6,160,368.11	-	-	103,796,563.40	109,956,931.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,330,061.59	2,330,061.59
应付管理人报酬	-	-	-	93,503.94	93,503.94
应付托管费	-	-	-	23,375.99	23,375.99
其他负债	-	-	-	347,254.11	347,254.11
负债总计	-	-	-	2,794,195.63	2,794,195.63
利率敏感度缺口	6,160,368.11	-	-	101,002,367.77	107,162,735.88
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
资产					
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
资产总计	9,371,980.81	-	-	106,581,698.15	115,953,678.96

负债					
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
负债总计	-	-	-	3,481,748.36	3,481,748.36
利率敏感度缺口	9,371,980.81	-	-	103,099,949.79	112,471,930.60

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 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)

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2014 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	2,395,141.70	-	-	2,395,141.70
交易性金融资产	100,813,207.70	-	-	100,813,207.70
应收股利	131,104.65	-	-	131,104.65
应收证券清算款	2,679,332.89	-	-	2,679,332.89
资产合计	106,018,786.94	-	-	106,018,786.94
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	106,018,786.94	-	-	106,018,786.94
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

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 530	增加约 558
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 530	减少约 558

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%-95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%-20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2014 年 12 月 31 日		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	100,813,207.70	94.07	105,853,653.46	94.12
衍生金融资产-权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	-	0.00	-	0.00
合计	100,813,207.70	94.07	105,853,653.46	94.12

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 515	增加约 536
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 515	减少约 536

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为100,813,207.70元，无属于第二层次和第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次105,853,653.46元，无第二层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,813,207.70	91.68
	其中：普通股	100,813,207.70	91.68
	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	6,140,744.45	5.58
8	其他各项资产	3,002,979.36	2.73
9	合计	109,956,931.51	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	100,813,207.70	94.07

合计	100,813,207.70	94.07
----	----------------	-------

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
金融	17,127,914.55	15.98
消费者非必需品	16,896,188.42	15.77
工业	12,896,715.90	12.03
信息技术	12,864,516.73	12.00
医疗保健	10,844,439.30	10.12
能源	9,023,733.98	8.42
消费者常用品	8,069,977.03	7.53
公用事业	6,081,883.19	5.68
基础材料	5,832,535.15	5.44
电信服务	1,175,303.45	1.10
合计	100,813,207.70	94.07

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
1	Nabors Industries Ltd	Nabors Industries	NBR UN	纽约交易所	US	3,246	257,812.32	0.24
2	Denbury Resources Inc	Denbury 资源公司	DNR UN	纽约交易所	US	5,071	252,269.42	0.24
3	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	570	232,219.72	0.22
4	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	544	230,148.81	0.21
5	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	US	612	229,220.92	0.21
6	Noble Corp plc	Noble 股份有限公司	NE UN	纽约交易所	US	2,235	226,610.74	0.21
7	Chesapeake	切萨皮克能	CHK UN	纽约交	US	1,882	225,367.30	0.21

	Energy Corp	源公司		易所				
8	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	US	247	224,970.85	0.21
9	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	US	962	224,215.95	0.21
10	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	US	813	223,714.37	0.21
11	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	US	941	223,409.59	0.21
12	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	1,345	223,199.09	0.21
13	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	722	223,193.22	0.21
14	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	US	442	223,129.34	0.21
15	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	US	459	222,976.42	0.21
16	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	1,589	222,950.48	0.21
17	Accenture plc	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易所	US	407	222,420.57	0.21
18	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	US	359	222,330.13	0.21
19	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	1,747	222,029.08	0.21
20	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	1,344	221,964.03	0.21
21	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	600	221,752.56	0.21
22	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约交易所	US	537	221,535.58	0.21
23	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	US	936	221,420.67	0.21
24	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	US	704	221,075.06	0.21

25	Transocean Ltd	Transocean 公司	RIG UN	纽约交易所	US	1,970	220,957.70	0.21
26	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	US	1,275	220,710.80	0.21
27	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	US	575	220,499.69	0.21
28	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	723	220,272.80	0.21
29	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	US	487	219,980.13	0.21
30	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	US	1,200	219,916.86	0.21
31	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	535	219,597.45	0.20
32	Mylan Inc.	迈兰实验室	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	636	219,374.23	0.20
33	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	844	219,075.38	0.20
34	Kraft Foods Group Inc.	卡夫食品集团股份有限公司	KRFT UQ	纳斯达克交易所	US	571	218,930.84	0.20
35	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	US	131	218,465.07	0.20
36	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	1,970	218,426.27	0.20
37	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约交易所	US	1,026	218,289.33	0.20
38	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price	TROW UQ	纳斯达克交易所	US	414	217,506.22	0.20
39	Cablevision Systems Co A	有线电视系统公司	CVC UN	纽约交易所	US	1,721	217,355.69	0.20
40	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	US	711	217,312.92	0.20
41	Fossil Group Inc	化石集团	FOSL UQ	纳斯达克交易所	US	320	216,837.78	0.20
42	Avery	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交	US	682	216,503.44	0.20

	Dennison Corp			易所				
43	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	US	337	216,458.95	0.20
44	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	327	216,438.76	0.20
45	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	755	216,393.54	0.20
46	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	US	591	216,364.96	0.20
47	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	US	816	216,351.20	0.20
48	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	843	216,133.48	0.20
49	Quest Diagnostics	Quest Diagnostics	DGX UN	纽约交易所	US	526	215,838.91	0.20
50	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	1,038	215,697.69	0.20
51	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	669	215,569.56	0.20
52	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	US	1,964	215,237.29	0.20
53	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	1,963	214,887.47	0.20
54	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	US	740	214,765.89	0.20
55	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	409	214,629.06	0.20
56	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	460	214,398.75	0.20
57	Roper Industries Inc	Roper 工业股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	224	214,302.07	0.20

58	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	US	336	214,254.09	0.20
59	Legg Mason Inc	Legg Mason Inc	LM UN	纽约交易所	US	656	214,230.60	0.20
60	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	US	304	213,920.24	0.20
61	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	US	2,636	213,718.31	0.20
62	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	637	213,677.56	0.20
63	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	264	213,638.77	0.20
64	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern	KSU UN	纽约交易所	US	286	213,556.65	0.20
65	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	US	756	213,395.72	0.20
66	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	US	329	213,394.01	0.20
67	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	US	550	213,335.88	0.20
68	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	US	444	213,271.63	0.20
69	PNC Financial Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交易所	US	382	213,246.29	0.20
70	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	US	774	213,219.49	0.20
71	Genworth Financial Inc	Genworth 金融公司	GNW UN	纽约交易所	US	4,098	213,143.13	0.20
72	Assurant Inc	Assurant Inc	AIZ UN	纽约交易所	US	509	213,130.09	0.20
73	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	US	277	213,006.00	0.20
74	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克默伦股份有限公司	FCX UN	纽约交易所	US	1,490	212,980.36	0.20
75	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	US	552	212,963.23	0.20

76	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	US	302	212,845.50	0.20
77	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	US	1,380	212,794.34	0.20
78	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	US	348	212,770.85	0.20
79	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	US	325	212,509.81	0.20
80	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	US	179	212,302.19	0.20
81	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	US	179	212,203.62	0.20
82	CVS Health Corporation	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	US	360	212,155.52	0.20
83	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	US	502	212,134.23	0.20
84	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	US	600	211,729.64	0.20
85	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	US	441	211,668.69	0.20
86	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	US	526	211,558.18	0.20
87	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼	DIS UN	纽约交易所	US	367	211,519.94	0.20
88	General Motors Company	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	US	990	211,478.15	0.20
89	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	1,723	211,387.89	0.20
90	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	1,424	211,344.88	0.20
91	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	NOV UN	纽约交易所	US	527	211,315.44	0.20
92	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	US	527	211,186.45	0.20
93	Sherwin-Wil	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交	US	131	210,849.97	0.20

	liams Co			易所				
94	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	US	1,343	210,828.13	0.20
95	MeadWestvac o Corp	MeadWestvac o	MWV UN	纽约交易所	US	775	210,507.37	0.20
96	Stanley Black & Decker	史丹利 Black & Decker 公司	SWK UN	纽约交易所	US	358	210,473.04	0.20
97	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	433	210,345.95	0.20
98	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	US	549	210,226.93	0.20
99	Frontier Communications Corp	公民通信	FTR UQ	纳斯达克交易所	US	5,150	210,190.71	0.20
100	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	US	478	210,123.52	0.20
101	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	US	770	210,115.14	0.20
102	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	US	659	210,089.13	0.20
103	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	US	977	210,016.38	0.20
104	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	纽约交易所	US	416	209,825.89	0.20
105	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	US	410	209,584.32	0.20
106	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	US	3,253	209,401.73	0.20
107	Horton D. R. Inc	DR Horton Inc	DHI UN	纽约交易所	US	1,353	209,376.09	0.20
108	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	379	209,322.06	0.20
109	Molson Coors Brewing Co B	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交易所	US	459	209,298.44	0.20
110	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约交易所	US	477	209,275.31	0.20

111	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交易所	US	719	209,243.12	0.20
112	Block H & R Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	US	1,015	209,179.24	0.20
113	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	US	340	209,169.45	0.20
114	AGL Resources	AGL Resources Inc	GAS UN	纽约交易所	US	627	209,133.77	0.20
115	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	US	707	209,125.27	0.20
116	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	US	237	209,075.77	0.20
117	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	US	501	208,983.25	0.20
118	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	330	208,933.87	0.19
119	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	764	208,922.00	0.19
120	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	422	208,823.97	0.19
121	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	US	759	208,715.79	0.19
122	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	US	469	208,692.66	0.19
123	Perrigo Company plc	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	US	204	208,661.82	0.19
124	McGraw Hill Financial Inc	麦格希	MHFI UN	纽约交易所	US	383	208,531.48	0.19
125	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	629	208,261.33	0.19
126	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	US	422	208,152.59	0.19
127	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	632	208,094.46	0.19

128	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	723	207,996.13	0.19
129	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	281	207,983.34	0.19
130	Affiliated Managers Grp	联合经理集团股份有限公司	AMG UN	纽约交易所	US	160	207,791.45	0.19
131	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	US	653	207,776.76	0.19
132	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	US	335	207,774.32	0.19
133	Northeast Utilities	Northeast Utilities	NU UN	纽约交易所	US	634	207,627.95	0.19
134	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	US	395	207,572.39	0.19
135	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	207,476.02	0.19
136	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	US	343	207,468.06	0.19
137	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	US	230	207,432.26	0.19
138	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	US	472	207,428.23	0.19
139	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	498	207,244.29	0.19
140	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	345	207,242.27	0.19
141	QEP Resources	QEP 资源公司	QEP UN	纽约交易所	US	1,675	207,241.35	0.19
142	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	610	207,233.40	0.19
143	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	985	207,155.38	0.19
144	Republic	公共服务公	RSG UN	纽约交	US	841	207,129.68	0.19

	Services Inc	司		易所				
145	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	US	800	207,115.91	0.19
146	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	US	527	207,058.82	0.19
147	AbbVie Inc.	艾伯维有限公司	ABBV UN	纽约交易所	US	517	207,020.95	0.19
148	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克克交易所	US	671	207,016.91	0.19
149	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克克交易所	US	1,183	206,811.86	0.19
150	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	931	206,793.44	0.19
151	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	US	887	206,626.94	0.19
152	Covidien Plc	Covidien 公共股份公司	COV UN	纽约交易所	US	330	206,530.94	0.19
153	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	US	2,432	206,256.31	0.19
154	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	US	515	206,220.09	0.19
155	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	US	404	206,195.86	0.19
156	Charles Schwab Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	US	1,116	206,161.59	0.19
157	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	US	194	206,149.35	0.19
158	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	US	442	206,090.37	0.19
159	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	US	511	206,087.98	0.19
160	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	US	316	206,064.18	0.19
161	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克克交易所	US	1,558	206,016.82	0.19
162	L Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LB UN	纽约交易所	US	389	206,014.19	0.19
163	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	US	259	205,995.03	0.19
164	AFLAC Inc	家庭人寿保	AFL UN	纽约交	US	551	205,969.15	0.19

		险		易所				
165	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	US	680	205,965.54	0.19
166	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	US	206	205,955.38	0.19
167	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	738	205,921.48	0.19
168	Grainger W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	US	132	205,876.69	0.19
169	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合伙公司	DVA UN	纽约交易所	US	444	205,773.16	0.19
170	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	US	855	205,764.53	0.19
171	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	US	3,184	205,739.38	0.19
172	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	US	967	205,618.29	0.19
173	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	US	407	205,585.24	0.19
174	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交易所	US	926	205,569.52	0.19
175	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	US	553	205,464.76	0.19
176	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	US	863	205,366.31	0.19
177	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	US	797	205,363.86	0.19
178	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	US	153	205,300.83	0.19
179	Safeway Inc	美国西夫韦股份有限公司	SWY UN	纽约交易所	US	955	205,228.81	0.19
180	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	US	794	205,125.28	0.19
181	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	US	460	205,053.81	0.19

182	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	826	205,052.71	0.19
183	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	476	204,991.88	0.19
184	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	626	204,797.36	0.19
185	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	891	204,778.21	0.19
186	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	587	204,735.62	0.19
187	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	267	204,695.42	0.19
188	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	US	680	204,675.65	0.19
189	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	597	204,606.94	0.19
190	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	255	204,530.02	0.19
191	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	377	204,503.40	0.19
192	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	US	452	204,502.36	0.19
193	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	US	1,177	204,466.57	0.19
194	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	US	506	204,381.09	0.19
195	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	US	759	204,350.12	0.19
196	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	US	391	204,345.90	0.19
197	Varian Medical	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	US	386	204,330.91	0.19

	Systems Inc	司						
198	TECO Energy Inc	TECO 能源	TE UN	纽约交易所	US	1,629	204,241.27	0.19
199	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	308	204,202.04	0.19
200	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	US	491	204,180.99	0.19
201	Cigna Corporation	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	324	204,024.84	0.19
202	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	US	309	204,014.19	0.19
203	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交易所	US	571	203,976.74	0.19
204	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	259	203,950.61	0.19
205	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	US	260	203,910.78	0.19
206	J. M. Smucker Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	US	330	203,905.88	0.19
207	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	US	782	203,891.32	0.19
208	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	1,552	203,798.92	0.19
209	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	US	624	203,627.59	0.19
210	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约交易所	US	632	203,531.16	0.19
211	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	US	614	203,520.27	0.19
212	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers	TRV UN	纽约交易所	US	314	203,376.59	0.19
213	Keurig Green Mountain Inc	KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	GMCR UQ	纳斯达克交易所	US	251	203,341.41	0.19
214	Lowes Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	US	483	203,336.82	0.19
215	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	US	741	203,176.56	0.19
216	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	507	203,140.76	0.19

217	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店	FDO UN	纽约交易所	US	419	203,083.43	0.19
218	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	527	203,027.93	0.19
219	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	385	202,977.02	0.19
220	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	US	623	202,958.17	0.19
221	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	US	425	202,896.86	0.19
222	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	US	346	202,846.44	0.19
223	Walgreens Boots Alliance Inc	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克交易所	US	435	202,826.49	0.19
224	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	US	431	202,807.52	0.19
225	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	US	783	202,762.61	0.19
226	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	97	202,760.22	0.19
227	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	US	462	202,750.86	0.19
228	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	US	850	202,740.83	0.19
229	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	US	565	202,697.69	0.19
230	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	US	278	202,649.90	0.19
231	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	462	202,637.78	0.19
232	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交易所	US	391	202,575.43	0.19
233	Carnival	嘉年华公司	CCL UN	纽约交	US	730	202,483.22	0.19

	Corp			易所				
234	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	523	202,414.99	0.19
235	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	US	353	202,392.66	0.19
236	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	706	202,349.46	0.19
237	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	US	824	202,337.71	0.19
238	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	311	202,270.83	0.19
239	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	US	318	202,231.36	0.19
240	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	US	1,111	202,178.74	0.19
241	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	US	126	202,154.63	0.19
242	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	1,325	202,043.26	0.19
243	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	US	502	201,966.77	0.19
244	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	US	137	201,930.43	0.19
245	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	US	382	201,886.25	0.19
246	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	US	546	201,828.24	0.19
247	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	US	510	201,783.82	0.19
248	Salesforce.com	Salesforce.com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	US	556	201,782.35	0.19
249	CenturyLink Inc	CenturyLink Inc	CTL UN	纽约交易所	US	833	201,744.29	0.19
250	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	US	355	201,692.95	0.19
251	Allergan Inc	爱力根	AGN UN	纽约交易所	US	155	201,629.92	0.19
252	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	US	315	201,557.11	0.19

253	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	US	418	201,294.30	0.19
254	Avago Technologies Ltd	安华高科技有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	US	327	201,271.84	0.19
255	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	US	594	201,252.56	0.19
256	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	2,366	201,238.00	0.19
257	Target Corp	Target 百货公司	TGT UN	纽约交易所	US	433	201,125.59	0.19
258	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	US	417	201,118.92	0.19
259	DIRECTV	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	379	201,066.06	0.19
260	Integrus Energy Group Inc	英迪斯能源集团公司	TEG UN	纽约交易所	US	422	201,025.67	0.19
261	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	US	236	200,958.73	0.19
262	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	US	142	200,845.77	0.19
263	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	356	200,823.38	0.19
264	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	US	260	200,792.54	0.19
265	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	375	200,733.80	0.19
266	Wisconsin Energy Corp	威斯康星能源公司	WEC UN	纽约交易所	US	622	200,729.39	0.19
267	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	62	200,668.20	0.19
268	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	261	200,622.55	0.19

269	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	970	200,617.53	0.19
270	Mallinckrodt plc	Mallinckrodt 公司	MNK UN	纽约交易所	US	331	200,574.27	0.19
271	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	296	200,502.50	0.19
272	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	393	200,485.42	0.19
273	PETSMART Inc	PetSmart 股份有限公司	PETM UQ	纳斯达克交易所	US	403	200,470.00	0.19
274	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	US	254	200,417.44	0.19
275	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	705	200,380.42	0.19
276	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	1,216	200,378.16	0.19
277	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	US	362	200,375.96	0.19
278	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	US	956	200,354.42	0.19
279	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	US	227	200,337.34	0.19
280	Gannett Co Inc	甘乃特	GCI UN	纽约交易所	US	1,025	200,264.16	0.19
281	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	US	477	200,168.77	0.19
282	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	199	200,089.34	0.19
283	Nielsen NV	尼尔森控股公司	NLSN UN	纽约交易所	US	731	200,076.80	0.19
284	CareFusion Corp.	CareFusion 公司	CFN UN	纽约交易所	US	551	200,068.90	0.19
285	Actavis plc	Actavis 公司	ACT UN	纽约交易所	US	127	200,036.66	0.19
286	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇	SIAL UQ	纳斯达克交易所	US	238	199,909.32	0.19

				所				
287	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	US	465	199,884.78	0.19
288	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	US	478	199,798.69	0.19
289	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	US	777	199,782.54	0.19
290	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	US	837	199,691.30	0.19
291	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易所	US	646	199,659.67	0.19
292	SanDisk Corp	SanDisk Corp	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	333	199,646.69	0.19
293	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	346	199,564.82	0.19
294	Alliance Data Systems Corp	Alliance Data Systems Corp	ADS UN	纽约交易所	US	114	199,538.75	0.19
295	Twenty-First Century Fox, Inc	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	US	849	199,515.20	0.19
296	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	US	552	199,384.92	0.19
297	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	899	199,300.54	0.19
298	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	679	199,264.26	0.19
299	O'Reilly Automotive	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	169	199,190.46	0.19
300	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	US	381	199,142.98	0.19
301	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	US	169	199,138.76	0.19
302	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	91	199,099.78	0.19
303	Plum Creek	Plum Creek	PCL UN	纽约交	US	760	198,992.33	0.19

	Timber Co	林业		易所				
304	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	489	198,980.70	0.19
305	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	1,596	198,980.70	0.19
306	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	895	198,961.43	0.19
307	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	US	905	198,914.00	0.19
308	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	458	198,893.57	0.19
309	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	712	198,884.63	0.19
310	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	US	766	198,875.94	0.19
311	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	US	615	198,809.06	0.19
312	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	US	276	198,793.83	0.19
313	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约交易所	US	489	198,741.33	0.19
314	General Growth Properties Inc	通用增长物业公司	GGP UN	纽约交易所	US	1,154	198,635.10	0.19
315	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	US	1,167	198,623.41	0.19
316	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	US	505	198,600.41	0.19
317	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	380	198,480.78	0.19
318	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	273	198,453.86	0.19
319	CH Robinson Worldwide	罗宾逊全球物流有限公	CHRW UQ	纳斯达克交易所	US	433	198,423.08	0.19

	Inc	司		所				
320	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	436	198,357.18	0.19
321	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	US	337	198,271.20	0.19
322	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	US	250	198,194.41	0.18
323	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	213	198,186.94	0.18
324	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	US	893	197,970.39	0.18
325	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	US	776	197,958.46	0.18
326	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	872	197,850.28	0.18
327	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	US	433	197,813.69	0.18
328	Under Armour Inc A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	US	476	197,768.53	0.18
329	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	US	290	197,609.43	0.18
330	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	431	197,532.95	0.18
331	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	US	519	197,532.33	0.18
332	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	US	922	197,516.55	0.18
333	Allegion plc	Allegion 公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	US	582	197,507.37	0.18
334	Zoetis Inc	硕腾公司	ZTS UN	纽约交易所	US	750	197,475.43	0.18
335	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	236	197,464.05	0.18
336	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约交易所	US	1,283	197,366.02	0.18
337	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	729	197,254.41	0.18
338	PerkinElmer Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	US	737	197,209.31	0.18

339	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控 股有限公司	KORS UN	纽约交 易所	US	429	197, 141. 33	0. 18
340	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交 易所	US	1, 274	196, 994. 96	0. 18
341	Rockwell Collins	洛克威尔克 林斯	COL UN	纽约交 易所	US	381	196, 951. 52	0. 18
342	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达 克交易 所	US	227	196, 892. 59	0. 18
343	McKesson Corp	McKesson 公 司	MCK UN	纽约交 易所	US	155	196, 878. 21	0. 18
344	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交 易所	US	653	196, 868. 48	0. 18
345	Bard C. R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交 易所	US	193	196, 772. 72	0. 18
346	Brown-Forma n Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交 易所	US	366	196, 722. 42	0. 18
347	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈 撒韦公司	BRK/B UN	纽约交 易所	US	214	196, 616. 32	0. 18
348	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交 易所	US	594	196, 600. 17	0. 18
349	NetApp Inc	网域存储技 术	NTAP UQ	纳斯达 克交易 所	US	775	196, 565. 23	0. 18
350	Kimberly-Cl ark	金佰利	KMB UN	纽约交 易所	US	278	196, 543. 01	0. 18
351	Southern Co	南方	SO UN	纽约交 易所	US	654	196, 529. 67	0. 18
352	Starwood Hotel & Resort World	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交 易所	US	396	196, 442. 66	0. 18
353	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交 易所	US	432	196, 405. 21	0. 18
354	US Bancorp	美国合众银 行	USB UN	纽约交 易所	US	714	196, 385. 02	0. 18
355	AT&T Inc	美国电话电 报集团	T UN	纽约交 易所	US	955	196, 288. 04	0. 18
356	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交 易所	US	340	196, 249. 79	0. 18
357	Progressive Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交 易所	US	1, 188	196, 200. 35	0. 18

358	Teradata Corp	美商天睿信息系 统有限公司	TDC UN	纽约交 易所	US	734	196,181.99	0.18
359	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交 易所	US	374	196,147.85	0.18
360	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交 易所	US	317	196,086.60	0.18
361	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交 易所	US	362	195,967.95	0.18
362	Range Resources Corp	Range 资源 公司	RRC UN	纽约交 易所	US	599	195,909.27	0.18
363	Alexion Pharmaceuticals Inc	Alexion 制 药公司	ALXN UQ	纳斯达 克交易 所	US	173	195,870.35	0.18
364	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交 易所	US	344	195,843.25	0.18
365	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交 易所	US	917	195,715.97	0.18
366	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交 易所	US	306	195,704.71	0.18
367	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,050	195,639.73	0.18
368	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交 易所	US	251	195,638.99	0.18
369	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交 易所	US	570	195,562.63	0.18
370	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达 克交易 所	US	532	195,513.80	0.18
371	Philip Morris International	菲利普莫里 斯国际集团 公司	PM UN	纽约交 易所	US	392	195,369.88	0.18
372	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交 易所	US	742	195,369.02	0.18
373	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金 融	CINF UQ	纳斯达 克交易 所	US	616	195,363.03	0.18
374	The Priceline Group Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达 克交易 所	US	28	195,354.46	0.18

375	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	US	412	195,304.04	0.18
376	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	US	807	195,151.06	0.18
377	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	US	359	195,134.73	0.18
378	Cardinal Health Inc	Cardinal Health	CAH UN	纽约交易所	US	395	195,124.81	0.18
379	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	US	350	195,082.90	0.18
380	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	1,341	195,046.61	0.18
381	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	US	858	195,041.29	0.18
382	Zimmer Holdings Inc	捷迈控股	ZMH UN	纽约交易所	US	281	195,018.77	0.18
383	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	598	194,923.56	0.18
384	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	US	172	194,874.97	0.18
385	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	769	194,855.21	0.18
386	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	US	1,359	194,837.34	0.18
387	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	US	408	194,805.95	0.18
388	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	985	194,739.32	0.18
389	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	US	575	194,709.64	0.18
390	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	US	336	194,701.68	0.18
391	Verizon Communications Inc	Verizon 通讯股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	US	680	194,647.84	0.18

392	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	US	344	194,601.33	0.18
393	Public Storage	Public Storage	PSA UN	纽约交易所	US	172	194,548.71	0.18
394	Hospira Inc	Hospira 公司	HSP UN	纽约交易所	US	519	194,515.36	0.18
395	Patterson Cos Inc	Patterson Cos Inc	PDCO UQ	纳斯达克交易 所	US	660	194,253.77	0.18
396	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	US	449	194,243.37	0.18
397	Lam Research Corp	Lam Research 公 司	LRCX UQ	纳斯达克交易 所	US	400	194,192.58	0.18
398	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约交易所	US	554	194,039.36	0.18
399	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	276	194,014.40	0.18
400	NRG Energy	NRG 能源股 份有限公司	NRG UN	纽约交易所	US	1,176	193,930.69	0.18
401	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自 动化	ROK UN	纽约交易所	US	285	193,923.35	0.18
402	Waters Corp	活德	WAT UN	纽约交易所	US	281	193,815.16	0.18
403	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	US	265	193,724.79	0.18
404	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易 所	US	283	193,705.39	0.18
405	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	797	193,561.90	0.18
406	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	US	457	193,481.74	0.18
407	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯 网络互动公 司	SNI UN	纽约交易所	US	420	193,442.39	0.18
408	Essex Property Trust	埃塞克斯房 地产信托公 司	ESS UN	纽约交易所	US	153	193,420.37	0.18
409	AutoZone Inc	AutoZone 公 司	AZO UN	纽约交易所	US	51	193,205.04	0.18

410	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	US	589	193,107.20	0.18
411	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	US	1,013	193,084.74	0.18
412	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	562	192,989.83	0.18
413	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	US	203	192,981.51	0.18
414	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	US	212	192,975.64	0.18
415	Lorillard Inc	Lorillard 股份有限公司	LO UN	纽约交易所	US	501	192,950.06	0.18
416	Simon Property Group	Simon Property	SPG UN	纽约交易所	US	173	192,779.28	0.18
417	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOY UN	纽约交易所	US	677	192,712.03	0.18
418	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	US	2,287	192,699.49	0.18
419	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	285	192,493.34	0.18
420	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	US	553	192,166.40	0.18
421	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	US	875	192,159.55	0.18
422	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	680	192,109.68	0.18
423	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交易所	US	865	192,080.61	0.18
424	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	228	191,998.07	0.18
425	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	US	744	191,707.29	0.18
426	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	US	240	191,595.68	0.18
427	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交	US	218	191,594.09	0.18

				易所				
428	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	330	191,487.37	0.18
429	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	701	191,350.98	0.18
430	Altera Corp	Altera 公司	ALTR UQ	纳斯达克交易所	US	846	191,226.34	0.18
431	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	US	330	190,942.17	0.18
432	Medtronic plc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	US	432	190,854.06	0.18
433	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	691	190,735.41	0.18
434	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	414	190,628.27	0.18
435	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	US	1,971	190,436.07	0.18
436	Health Care REIT Inc	Health Care REIT 公司	HCN UN	纽约交易所	US	411	190,303.16	0.18
437	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	US	1,645	190,242.77	0.18
438	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	US	450	189,967.41	0.18
439	Amerisource Bergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	US	344	189,781.03	0.18
440	Biogen Idec Inc	百健艾迪	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	91	189,015.60	0.18
441	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	376	188,776.05	0.18
442	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	US	45	188,483.25	0.18
443	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	768	188,398.63	0.18
444	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	US	1,986	188,361.18	0.18
445	Regeneron Pharmaceuti	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	US	75	188,273.98	0.18

	cals Inc	司		所				
446	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克 克交易 所	US	559	188,094.45	0.18
447	Avon Products	雅芳	AVP UN	纽约交 易所	US	3,269	187,828.27	0.18
448	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗 用品	STJ UN	纽约交 易所	US	472	187,817.57	0.18
449	Mondelez Internation al Inc	Mondelez 国 际公司	MDLZ UQ	纳斯达 克交易 所	US	842	187,153.59	0.17
450	Windstream Holdings Inc	Windstream 控股公司	WIN UQ	纳斯达 克交易 所	US	3,701	186,606.49	0.17
451	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达 克交易 所	US	525	186,355.67	0.17
452	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交 易所	US	691	186,168.92	0.17
453	Level 3 Communicati ons	Level 3 通 信股份有 限公司	LVLN UN	纽约交 易所	US	615	185,826.08	0.17
454	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交 易所	US	277	185,784.89	0.17
455	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻 探公司	DO UN	纽约交 易所	US	827	185,767.76	0.17
456	Peoples United Financial Inc	People's United Financial 股	PBCT UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,995	185,308.41	0.17
457	Kohls Corp	Kohl's 公司	KSS UN	纽约交 易所	US	496	185,257.86	0.17
458	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达 克交易 所	US	190	185,192.15	0.17
459	News Corporation	美国新闻集 团	NWSA UQ	纳斯达 克交易 所	US	1,925	184,813.69	0.17
460	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交 易所	US	421	184,706.30	0.17
461	Chevron Corp	雪佛龙德士 古	CVX UN	纽约交 易所	US	268	183,963.08	0.17

462	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	547	183,922.76	0.17
463	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	527	183,905.38	0.17
464	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	694	183,834.71	0.17
465	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	US	396	183,818.19	0.17
466	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	US	412	183,278.74	0.17
467	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	2,959	183,233.94	0.17
468	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	US	325	183,097.31	0.17
469	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	317	182,838.29	0.17
470	Universal Health Services B	Universal Health Services 公	UHS UN	纽约交易所	US	268	182,454.38	0.17
471	Southwestern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交易所	US	1,092	182,350.36	0.17
472	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	959	181,589.03	0.17
473	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	US	676	181,424.43	0.17
474	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	US	421	181,151.28	0.17
475	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	998	180,821.22	0.17
476	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	397	180,565.63	0.17
477	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	US	401	179,833.07	0.17
478	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	599	179,782.03	0.17
479	Agilent Technologies	安捷伦	A UN	纽约交易所	US	715	179,115.98	0.17

	s Inc							
480	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	457	178,409.24	0.17
481	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	431	177,753.28	0.17
482	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	US	1,294	176,729.45	0.16
483	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	1,013	176,720.57	0.16
484	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	US	554	176,072.76	0.16
485	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	US	282	176,024.17	0.16
486	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	269	175,645.83	0.16
487	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	US	313	175,302.56	0.16
488	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	US	464	175,264.80	0.16
489	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	US	625	174,429.74	0.16
490	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	US	470	174,367.64	0.16
491	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	US	841	173,988.93	0.16
492	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	1,263	173,268.42	0.16
493	Martin Marietta Materials	Martin Marietta 材料股份有限	MLM UN	纽约交易所	US	255	172,137.26	0.16
494	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	US	90	170,912.85	0.16
495	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	US	172	168,857.97	0.16

496	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	US	1,129	168,356.51	0.16
497	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	US	535	165,876.61	0.15
498	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	349	161,659.70	0.15
499	Discovery Communications Inc C	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达克交易所	US	619	127,719.93	0.12
500	Google Inc A	谷歌公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	US	31	100,660.36	0.09
501	Google Inc C	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	31	99,852.29	0.09
502	Discovery Communications Inc A	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	335	70,617.85	0.07
503	Washington Prime Group Inc	WP GLIMCHER Inc	WPG UN	纽约交易所	US	0.5	52.68	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Cimarex Energy Co	XEC UN	349,807.76	0.31
2	Essex Property Trust	ESS UN	295,649.64	0.26
3	Transocean Ltd	RIG UN	293,545.51	0.26
4	Tractor Supply Co	TSCO UQ	286,578.00	0.25
5	Affiliated Managers Grp	AMG UN	286,316.24	0.25
6	Martin Marietta Materials	MLM UN	286,259.16	0.25
7	Mallinckrodt plc	MNK UN	272,973.64	0.24
8	Avago Technologies Ltd	AVGO UQ	270,936.02	0.24
9	Universal Health Services B	UHS UN	269,009.07	0.24
10	United Rentals Inc	URI UN	260,375.98	0.23
11	Keurig Green Mountain Inc	GMCR UQ	254,988.11	0.23
12	Under Armour Inc A	UA UN	248,578.91	0.22

13	Navient Corp	NAVI UQ	234,549.78	0.21
14	Ensco PLC - CL A	ESV UN	233,898.84	0.21
15	Noble Corp plc	NE UN	226,534.73	0.20
16	Level 3 Communications	LVLT UN	223,357.05	0.20
17	Nabors Industries Ltd	NBR UN	217,160.36	0.19
18	Royal Caribbean Cruises Ltd	RCL UN	208,335.14	0.19
19	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	201,045.03	0.18
20	Denbury Resources Inc	DNR UN	193,270.15	0.17

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Actavis plc	ACT UN	380,062.66	0.34
2	Jabil Circuit Inc	JBL UN	325,969.05	0.29
3	Graham Holdings Co	GHC UN	321,769.42	0.29
4	United States Steel Corp	X UN	299,910.19	0.27
5	Bemis Co Inc	BMS UN	297,104.42	0.26
6	Intl Game Technology	IGT UN	282,957.89	0.25
7	Allergan Inc	AGN UN	282,182.52	0.25
8	Southwest Airlines Co	LUV UN	277,470.55	0.25
9	Edwards Lifesciences Corp	EW UN	268,648.27	0.24
10	Cliffs Natural Resources Inc	CLF UN	265,396.73	0.24
11	Rowan Cos Plc	RDC UN	263,901.58	0.23
12	Vertex Pharmaceuticals Inc	VRTX UQ	261,711.36	0.23
13	Electronic Arts	EA UQ	249,068.06	0.22
14	Peabody Energy Corp	BTU UN	219,773.15	0.20
15	Newfield Exploration Co	NFX UN	216,040.55	0.19
16	The Williams Companies Inc	WMB UN	211,780.07	0.19
17	Alexion Pharmaceuticals Inc	ALXN UQ	208,641.52	0.19
18	Life Technologies Corp	LIFE UQ	207,965.94	0.18
19	WPX Energy Inc.	WPX UN	207,456.91	0.18
20	Monster Beverage Corp	MNST UQ	207,302.62	0.18

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	40,929,171.95
卖出收入（成交）总额	60,618,577.24

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

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.9 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融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

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

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

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,679,332.89
3	应收股利	131,104.65
4	应收利息	882.47
5	应收申购款	191,659.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,002,979.36

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,647	16,170.15	4,886,945.29	6.50%	70,255,755.97	93.50%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	79,567.67	0.1059%

9.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月23日）基金份额总额	822,754,222.26
本报告期期初基金份额总额	87,946,838.33
本报告期基金总申购份额	92,729,943.91
减：本报告期基金总赎回份额	105,534,080.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	75,142,701.26

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

1、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。

2、基金管理人于 2014 年 11 月 28 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三十九次会议审议通过，由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于 2014 年 12 月 20 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三十九次会议审议通过，由刘卓先生任公司董事长及法定代表人，张树忠先生不再担任公司董事长。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度支付的审计费用为 4 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	1	101,078,025.57	100.00%	30,322.79	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 个工作日内，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成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	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-5-22
16	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
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	2014-7-2
18	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-7-8
19	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-7-18
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天风证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-8-11
21	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-8-28
22	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年半年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-8-28
23	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-8-28

	的公告		
24	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-10-27
25	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书(2014 年第 2 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-11-7
26	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书摘要(2014 年第 2 期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-11-7
27	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告(20141125)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2014-11-25
28	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	2014-11-28
29	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	2014-12-20
30	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	2014-12-23

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由“托管及投资者服务部”更名为“托管业务部”。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 13 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六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

3、基金管理人于 2015 年 1 月 22 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六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

本期报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

13.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司
2015年3月28日