

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 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：2015 年 8 月 27 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 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作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.....	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.....	13
4.9 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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	29
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.....	31
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	59
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	61

7.11 投资组合报告附注.....	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§ 9 开放式基金份额变动.....	62
§ 10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成标普 500 等权重指数证券投资基金
基金简称	大成标普 500 等权重指数 QDII
基金主代码	096001
交易代码	096001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,650,993.76 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,899,135.92
本期利润	1,145,839.65
加权平均基金份额本期利润	0.0191
本期加权平均净值利润率	1.33%
本期基金份额净值增长率	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	15,330,901.36
期末可供分配基金份额利润	0.3595
期末基金资产净值	60,251,372.43

期末基金份额净值	1.413
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	43.76%

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。

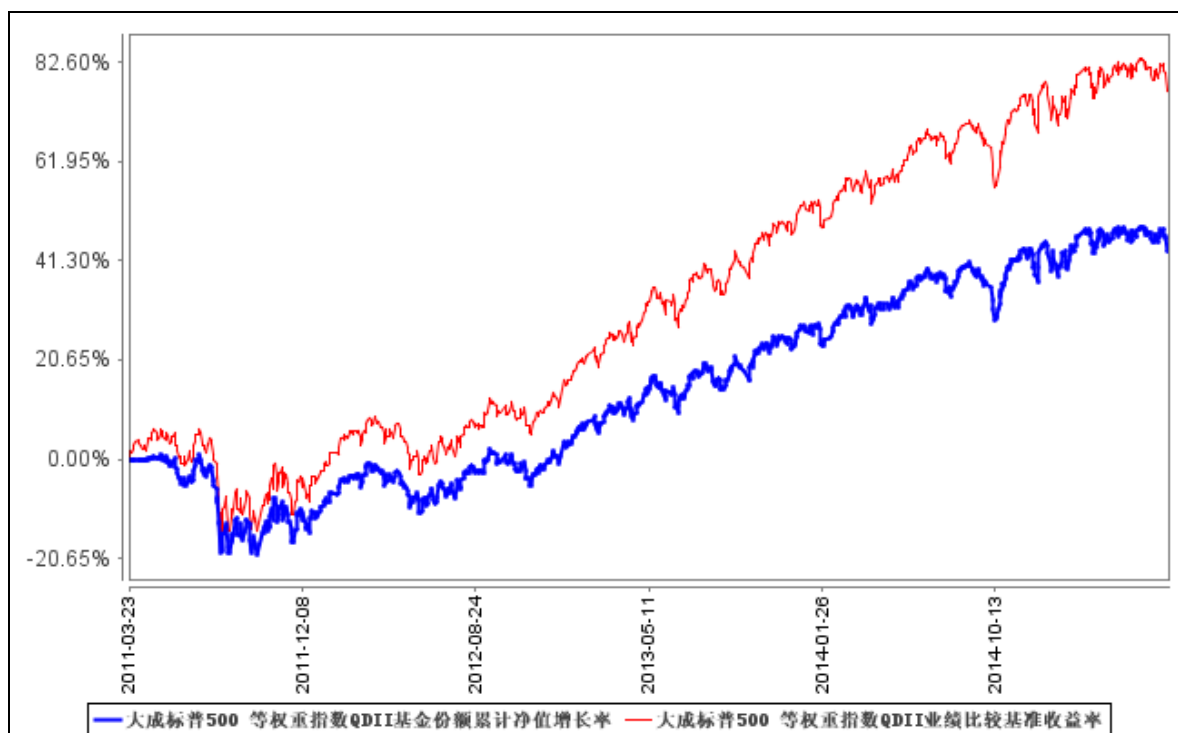
3.2 基金净值表现

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	-2.08%	0.67%	-2.23%	0.71%	0.15%	-0.04%
过去三个月	-1.40%	0.61%	-1.09%	0.63%	-0.31%	-0.02%
过去六个月	0.43%	0.79%	0.70%	0.80%	-0.27%	-0.01%
过去一年	4.08%	0.75%	6.11%	0.77%	-2.03%	-0.02%
过去三年	51.96%	0.73%	70.89%	0.77%	-18.93%	-0.04%
自基金合同生效起至今	43.76%	1.01%	77.05%	1.07%	-33.29%	-0.06%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 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、大成深证成份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 51 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、大成积极成长混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成策略回报混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (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、大成健康产业混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (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、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成互联网思维混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、大成中证互联网金融指数分级证券投资基金及大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金 (本基金 2015 年 7 月 8 日成立) 等。

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	-	12 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《大成标普 500 等权重指数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，大成标普 500 等权重指数型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。2015 上半年公司旗下主动投资组合间股票交易存在 40 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 1 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

2015 年上半年，全球宏观经济保持了缓慢但相对稳定的增长，国际金融市场也相对稳定。

2015 年上半年，从欧洲方面来看，欧洲经济出现逐步复苏的迹象，因此欧元区的主要股票指数都有良好的表现。虽然在 2 季度的时候，希腊危机曾经重燃，希腊全民公投的结果更是将希腊退出欧元区风险进一步推高，但是最终希腊政府还是采取了向欧元区领导国妥协的政策，暂时平息了此次希腊危机。

2015 年上半年，美国经济增长略微偏弱。2015 年 1 季度的年化季环比 GDP 增长率为 0.6%，显著低于近 1 年的平均水平。1 季度宏观经济较弱的原因主要有（1）今年年初，美国出现严重的暴风雪天气，影响了经济活动；（2）美元短期内过强对美国净出口造成负面影响。

进入 2 季度，美国宏观经济增速有所恢复，2 季度的年化季环比 GDP 增长率为 2.3%，接近长期趋势水平。房屋销售和个人消费都是期内经济增长的重要引擎。

由于上半年美国宏观经济表现相对较弱，所以本基金所跟踪的标普 500 等权重指数在期内并未取得较高收益率。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 0.70%，美元兑人民币中间价下跌 0.09%，经汇率调整后的目标指数上涨 0.61%。在本报告期内，本基金净值上涨 0.43%，低于经汇率调整后的目标指数 0.18%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 0.85%，日均偏差绝对值为 0.042%，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 1.413 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.7%，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

展望欧洲方面，欧洲的经济复苏仍然在持续，同时希腊政府已经妥协于欧元区主要领导国，希腊危机暂时平息，不会因此引发严重的金融危机。

从美国自身来看，虽然上半年经济增速放缓，但美国经济长期增长的逻辑不变，未来经济增长潜力依然较大。个人消费和房地产市场有望持续成为经济增长的主要驱动力。

当前市场普遍预计美联储在四季度加息一次的可能性较大，主要理由是：（1）当前通胀无压力，美联储不急于加息；（2）短期经济数据表现一般。从历史实证分析来看，加息初期在不会对股票指数的长期业绩产生负面影响。

随着美国宏观经济恢复增长的动能，本指数成分股企业盈利也有望保持增长。当前标普 500 指数的动态市盈率在 17 倍左右，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。

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、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、专户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、固定收益总部、风险管理部和专户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/中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。

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 1,347,678.32 元(每十份基金份额分红 0.187 元),符合基金合同规定的分红比例。

4.9 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	5,776,567.05	6,140,744.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.2.2	57,017,532.26	100,813,207.70
其中：股票投资		57,017,532.26	100,813,207.70
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	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		111,393.34	2,679,332.89
应收利息	6.4.2.5	601.78	882.47
应收股利		65,077.74	131,104.65
应收申购款		126,670.69	191,659.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	103,629.45	-
资产总计		63,201,472.31	109,956,931.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		237,757.84	-
应付赎回款		2,372,388.45	2,330,061.59
应付管理人报酬		52,689.31	93,503.94
应付托管费		13,172.33	23,375.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	274,091.95	347,254.11
负债合计		2,950,099.88	2,794,195.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	42,650,993.76	75,142,701.26
未分配利润	6.4.2.10	17,600,378.67	32,020,034.62
所有者权益合计		60,251,372.43	107,162,735.88
负债和所有者权益总计		63,201,472.31	109,956,931.51

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.413 元，基金份额总额 42,650,993.76 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		1,970,502.17	11,482,617.60
1. 利息收入		12,294.63	21,335.08
其中：存款利息收入	6.4.2.11	12,294.63	21,335.08
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）		11,054,446.23	2,484,882.93
其中：股票投资收益	6.4.2.12	9,947,494.50	1,449,276.27
基金投资收益	6.4.2.13	-	-
债券投资收益	6.4.2.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.2.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.2.15	-	-
衍生工具收益	6.4.2.16	-	-
股利收益	6.4.2.17	1,106,951.73	1,035,606.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.2.18	-9,753,296.27	9,005,171.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		605,818.12	-94,663.93
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.2.19	51,239.46	65,891.61
减：二、费用		824,662.52	1,080,082.29
1. 管理人报酬	6.4.5.1.1	430,178.38	633,228.08
2. 托管费	6.4.5.1.2	107,544.58	158,307.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.2.20	15,827.49	10,770.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6. 4. 2. 21	271, 112. 07	277, 776. 94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 145, 839. 65	10, 402, 535. 31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 145, 839. 65	10, 402, 535. 31

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	75, 142, 701. 26	32, 020, 034. 62	107, 162, 735. 88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1, 145, 839. 65	1, 145, 839. 65
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）	-32, 491, 707. 50	-14, 217, 817. 28	-46, 709, 524. 78
其中：1. 基金申购款	14, 546, 060. 11	6, 180, 551. 05	20, 726, 611. 16
2. 基金赎回款	-47, 037, 767. 61	-20, 398, 368. 33	-67, 436, 135. 94
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）	-	-1, 347, 678. 32	-1, 347, 678. 32
五、期末所有者权益（基金净值）	42, 650, 993. 76	17, 600, 378. 67	60, 251, 372. 43
项目	上年度可比期间 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	-	10, 402, 535. 31	10, 402, 535. 31

期净利润)			
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
2.基金赎回款	-43,730,708.20	-13,315,137.52	-57,045,845.72
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)	106,343,135.22	39,977,979.30	146,321,114.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗登攀</u>	<u>肖剑</u>	<u>范瑛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 会计政策和会计估计变更的说明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.2 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	5,776,567.05
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	5,776,567.05
-----	--------------

6.4.2.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	46,671,873.38	57,017,532.26	10,345,658.88
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	46,671,873.38	57,017,532.26	10,345,658.88

6.4.2.3 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。

6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.2.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	601.78
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	601.78

6.4.2.6 其他资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
----	-------------------

其他应收款	-
待摊费用	103,629.45
合计	103,629.45

6.4.2.7 应付交易费用

本基金于本期末无应付交易费用。

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,488.64
预提费用	268,603.31
合计	274,091.95

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	75,142,701.26	75,142,701.26
本期申购	14,546,060.11	14,546,060.11
本期赎回(以“-”号填列)	-47,037,767.61	-47,037,767.61
本期末	42,650,993.76	42,650,993.76

6.4.2.10 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	13,996,093.01	18,023,941.61	32,020,034.62
本期利润	10,899,135.92	-9,753,296.27	1,145,839.65
本期基金份额交易产生的变动数	-8,216,649.25	-6,001,168.03	-14,217,817.28
其中：基金申购款	3,277,538.10	2,903,012.95	6,180,551.05
基金赎回款	-11,494,187.35	-8,904,180.98	-20,398,368.33
本期已分配利润	-1,347,678.32	-	-1,347,678.32
本期末	15,330,901.36	2,269,477.31	17,600,378.67

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	12,244.66

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	49.97
合计	12,294.63

6.4.2.12 股票投资收益

6.4.2.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	46,746,739.45
减：卖出股票成本总额	36,799,244.95
买卖股票差价收入	9,947,494.50

6.4.2.13 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

6.4.2.14 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.2.15 贵金属投资收益

本报告期内本基金无金属投资收益。

6.4.2.16 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.2.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,106,951.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,106,951.73

6.4.2.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,753,296.27
——股票投资	-9,753,296.27
——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	-9,753,296.27

6.4.2.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	51,239.46
合计	51,239.46

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。

6.4.2.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	15,827.49
银行间市场交易费用	-
合计	15,827.49

6.4.2.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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	98,558.25
银行汇划费	1,864.14
其他	2,086.37
合计	271,112.07

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.5.1 关联方报酬

6.4.5.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	430,178.38	633,228.08
其中：支付销售机构的客户维护费	157,489.68	231,904.35

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。

6.4.5.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,544.58	158,307.00

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.5.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.5.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期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。

6.4.5.3.2 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。

6.4.5.4 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	750,118.18	-	5,006,840.87	-
中国银行	5,026,448.87	12,244.66	6,384,997.30	21,254.10

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。

6.4.5.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.6 利润分配情况

6.4.6.1 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	2015 年 1 月 20 日	2015 年 1 月 19 日	0.187	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	-
合计			0.187	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	-

6.4.7 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.8.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,776,567.05	-	-	-	5,776,567.05
交易性金融资产	-	-	-	57,017,532.26	57,017,532.26
应收证券清算款	-	-	-	111,393.34	111,393.34
应收利息	-	-	-	601.78	601.78
应收股利	-	-	-	65,077.74	65,077.74
应收申购款	12,038.73	-	-	114,631.96	126,670.69
其他资产	-	-	-	103,629.45	103,629.45
资产总计	5,788,605.78	-	-	57,412,866.53	63,201,472.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	237,757.84	237,757.84
应付赎回款	-	-	-	2,372,388.45	2,372,388.45
应付管理人报酬	-	-	-	52,689.31	52,689.31
应付托管费	-	-	-	13,172.33	13,172.33
其他负债	-	-	-	274,091.95	274,091.95
负债总计	-	-	-	2,950,099.88	2,950,099.88
利率敏感度缺口	5,788,605.78	-	-	54,462,766.65	60,251,372.43
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 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

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。

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（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（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	750,134.56	-	-	750,134.56
交易性金融资产	57,017,532.26	-	-	57,017,532.26
应收股利	65,077.74	-	-	65,077.74
应收证券清算款	111,393.34	-	-	111,393.34
资产合计	57,944,137.90	-	-	57,944,137.90
以外币计价的负债				
应付证券清算款	237,757.84	-	-	237,757.84
负债合计	237,757.84	-	-	237,757.84

资产负债表外汇风险敞口净额	57,706,380.06	-	-	57,706,380.06
项目	上年度末 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

6.4.8.4.2.2 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 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	美元相对人民币升值 5%	增加约 289	增加约 530
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 289	减少约 530

6.4.8.4.3 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。

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	57,017,532.26	94.63	100,813,207.70	94.07
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	57,017,532.26	94.63	100,813,207.70	94.07

6.4.8.4.3.2 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 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	增加约 289	增加约 515
	业绩比较基准下降 5%	减少约 289	减少约 515

6.4.9 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	57,017,532.26	90.22
	其中：普通股票	57,017,532.26	90.22
	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	5,776,567.05	9.14
8	其他各项资产	407,373.00	0.64
9	合计	63,201,472.31	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	57,017,532.26	94.63
合计	57,017,532.26	94.63

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	占基金资产净值比例(%)
金融	10,040,484.81	16.66
消费者非必需品	9,605,147.79	15.94
信息技术	7,426,460.93	12.33
工业	7,325,487.50	12.16
医疗保健	6,549,409.04	10.87
能源	4,560,622.73	7.57
消费者常用品	4,290,662.24	7.12
公用事业	3,348,624.25	5.56
基础材料	3,293,787.62	5.47
电信服务	576,845.35	0.96
合计	57,017,532.26	94.63

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

7.4.1 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 净值比例(%)
1	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集 团股份有限 公司	WEC UN	纽约交易所	US	732	201,247.73	0.33
2	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公 司	WMB UN	纽约交易所	US	409	143,501.54	0.24
3	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	US	399	141,188.21	0.23
4	Cigna Corporatio n	CIGNA 公司	CI UN	纽约交易所	US	139	137,666.04	0.23
5	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食 品	CAG UN	纽约交易所	US	501	133,910.58	0.22
6	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	US	224	132,904.77	0.22
7	Valero Energy Corp	Valero 能 源	VLO UN	纽约交易所	US	343	131,270.00	0.22
8	Walt Disney Co	沃尔特迪斯 尼	DIS UN	纽约交易所	US	188	131,187.59	0.22
9	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	US	197	130,097.04	0.22
10	Unitedheal th Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	US	174	129,779.50	0.22
11	TripAdviso r Inc.	TripAdviso r 公司	TRIP UQ	纳斯达克交 易所	US	243	129,455.60	0.21
12	Edwards Lifescienc es Corp	Edwards Lifescienc es 公司	EW UN	纽约交易所	US	148	128,872.49	0.21
13	HCA Holdings Inc	HCA 控股公 司	HCA UN	纽约交易所	US	231	128,118.56	0.21
14	PerkinElme r Inc	铂金埃尔默	PKI UN	纽约交易所	US	398	128,084.32	0.21

15	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	US	164	127,795.27	0.21
16	Horton D.R. Inc	DR Horton 公司	DHI UN	纽约交易所	US	762	127,458.29	0.21
17	Accenture plc	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易所	US	215	127,209.95	0.21
18	Capital One Financial	第一资本金 融	COF UN	纽约交易所	US	236	126,923.96	0.21
19	Universal Health Services B	Universal Health Services 公司	UHS UN	纽约交易所	US	146	126,836.41	0.21
20	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达克交 易所	US	255	126,822.05	0.21
21	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达克交 易所	US	491	126,614.98	0.21
22	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	US	851	126,320.92	0.21
23	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	US	778	126,234.35	0.21
24	Assurant Inc	Assurant 公司	AIZ UN	纽约交易所	US	308	126,160.25	0.21
25	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达克交 易所	US	232	126,148.51	0.21
26	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	US	417	125,913.44	0.21
27	CF Industries Holdings	CF 工业控 股股份有限 公司	CF UN	纽约交易所	US	320	125,754.31	0.21
28	Alexion Pharmaceut icals Inc	Alexion 制 药公司	ALXN UQ	纳斯达克交 易所	US	113	124,882.57	0.21
29	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交 易所	US	1,805	124,806.39	0.21
30	Southwest ern Energy Co	西南能源公 司	SWN UN	纽约交易所	US	898	124,787.99	0.21
31	Prudential Financial	保德信金融 集团	PRU UN	纽约交易所	US	233	124,669.51	0.21

	Inc							
32	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	US	362	124,466.05	0.21
33	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约交易所	US	296	124,411.76	0.21
34	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	US	473	124,402.35	0.21
35	CVS Health Corporation	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	US	194	124,391.71	0.21
36	Allergan plc	眼力健有限公司	AGN UN	纽约交易所	US	67	124,300.61	0.21
37	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	US	357	124,252.87	0.21
38	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	US	162	124,221.32	0.21
39	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比海游轮有限公司	RCL UN	纽约交易所	US	258	124,118.43	0.21
40	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	US	304	123,592.54	0.21
41	Sigma-Aldrich Corp	西格玛-奥德里奇	SIAL UQ	纳斯达克交易所	US	145	123,529.87	0.21
42	Walgreens Boots Alliance Inc	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA UQ	纳斯达克交易所	US	239	123,379.54	0.20
43	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	US	749	123,360.59	0.20
44	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	US	684	123,234.77	0.20
45	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	US	259	123,142.76	0.20
46	Patterson Cos Inc	Patterson Cos 公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	US	414	123,134.63	0.20
47	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	US	235	122,966.81	0.20
48	Mastercard Inc A	万事达股份有限公司	MA UN	纽约交易所	US	215	122,872.36	0.20
49	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交易所	US	323	122,825.89	0.20
50	McCormick	味好美	MKC UN	纽约交易所	US	248	122,734.19	0.20

	& Co							
51	Facebook Inc	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克交易所	US	234	122,693.90	0.20
52	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	US	346	122,624.27	0.20
53	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	US	428	122,588.68	0.20
54	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	US	245	122,552.61	0.20
55	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	US	30	122,314.80	0.20
56	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	US	206	122,275.30	0.20
57	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	US	1,175	122,262.83	0.20
58	PNC Financial Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交易所	US	209	122,216.06	0.20
59	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交易所	US	160	122,203.53	0.20
60	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交易所	US	141	122,104.79	0.20
61	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达克交易所	US	859	122,099.29	0.20
62	Bristol-Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	US	300	122,039.68	0.20
63	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	US	172	121,999.58	0.20
64	Family Dollar Stores Inc	家庭美元商店	FDO UN	纽约交易所	US	253	121,898.64	0.20
65	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	US	464	121,865.08	0.20
66	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	US	280	121,675.31	0.20
67	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	US	161	121,540.08	0.20

68	Quest Diagnostic s	Quest Diagnostic s	DGX UN	纽约交易所	US	274	121,480.17	0.20
69	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交易所	US	417	121,477.54	0.20
70	Hartford Financial Services Group	哈特福德金 融服务	HIG UN	纽约交易所	US	477	121,225.90	0.20
71	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	US	257	120,982.03	0.20
72	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	US	265	120,956.96	0.20
73	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	US	590	120,943.51	0.20
74	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	US	208	120,893.75	0.20
75	National Oilwell Varco Inc	美国国民油 井	NOV UN	纽约交易所	US	409	120,722.32	0.20
76	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达克交 易所	US	649	120,678.43	0.20
77	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约交易所	US	245	120,665.35	0.20
78	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	US	281	120,563.74	0.20
79	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交 易所	US	718	120,537.45	0.20
80	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保 健合伙公司	DVA UN	纽约交易所	US	248	120,490.25	0.20
81	AGL Resources	AGL Resources 公司	GAS UN	纽约交易所	US	423	120,406.62	0.20
82	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交 易所	US	243	120,348.84	0.20
83	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交 易所	US	285	120,328.49	0.20
84	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	US	441	120,326.84	0.20
85	United	联合包裹服	UPS UN	纽约交易所	US	203	120,271.20	0.20

	Parcel Service Inc B	务股份有限公司						
86	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	US	453	120,194.60	0.20
87	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	US	162	120,056.68	0.20
88	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	US	237	120,014.31	0.20
89	Schein Henry Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达克交易所	US	138	119,903.35	0.20
90	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	US	384	119,822.65	0.20
91	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	US	262	119,795.87	0.20
92	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	US	451	119,774.23	0.20
93	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公司	PCP UN	纽约交易所	US	98	119,748.67	0.20
94	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交易所	US	232	119,723.36	0.20
95	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	US	280	119,706.73	0.20
96	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	US	224	119,703.31	0.20
97	AT&T Inc	美国电话电报集团	T UN	纽约交易所	US	551	119,652.44	0.20
98	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	US	459	119,625.85	0.20
99	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	US	374	119,606.10	0.20
100	Computer Sciences	电脑系统咨询	CSC UN	纽约交易所	US	298	119,586.42	0.20
101	Allegion plc	Allegion 公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	US	325	119,493.37	0.20
102	Under Armour Inc A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	US	234	119,367.80	0.20
103	J. M.	JM 斯马克	SJM UN	纽约交易所	US	180	119,299.57	0.20

	Smucker Co	公司						
104	Genworth Financial Inc	Genworth 金融公司	GNW UN	纽约交易所	US	2,573	119,078.32	0.20
105	Nasdaq OMX Group Inc	纳斯达克 OMX 集团股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	US	399	119,063.52	0.20
106	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	US	169	119,024.46	0.20
107	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	US	291	118,983.37	0.20
108	C.R. Bard Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交易所	US	114	118,969.43	0.20
109	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	US	87	118,934.40	0.20
110	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达克交易所	US	193	118,901.02	0.20
111	Level 3 Communications	Level 3 通信股份有限公司	LVLT UN	纽约交易所	US	369	118,819.22	0.20
112	Brown-Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交易所	US	194	118,817.33	0.20
113	Target Corp	Target 百货公司	TGT UN	纽约交易所	US	238	118,774.65	0.20
114	Hudson City Bancorp	哈得森城市银行	HCBK UQ	纳斯达克交易所	US	1,966	118,751.06	0.20
115	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	US	522	118,716.33	0.20
116	Medtronic plc	美敦力	MDT UN	纽约交易所	US	262	118,690.65	0.20
117	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达克交易所	US	362	118,656.60	0.20
118	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	US	38	118,511.77	0.20
119	Borgwarner Inc	博格华纳股份有限公司	BWA UN	纽约交易所	US	341	118,496.49	0.20
120	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG UQ	纳斯达克交易所	US	40	118,481.57	0.20
121	Mondelez International	Mondelez 国际公司	MDLZ UQ	纳斯达克交易所	US	471	118,462.86	0.20

	nal Inc							
122	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	US	377	118,422.02	0.20
123	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	US	118	118,411.38	0.20
124	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	US	162	118,402.70	0.20
125	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交易所	US	594	118,386.20	0.20
126	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达克交易所	US	177	118,328.42	0.20
127	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	US	249	118,312.10	0.20
128	Xylem Inc	Xylem 公司 / 纽约	XYL UN	纽约交易所	US	522	118,301.46	0.20
129	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	US	221	118,289.30	0.20
130	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	US	307	118,205.60	0.20
131	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	US	347	118,205.48	0.20
132	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交易所	US	502	118,188.24	0.20
133	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管理	AIV UN	纽约交易所	US	523	118,080.45	0.20
134	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	US	503	118,054.66	0.20
135	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交易所	US	579	117,945.28	0.20
136	Peoples United Financial Inc	Peoples United Financial 公司	PBCT UQ	纳斯达克交易所	US	1,190	117,930.73	0.20
137	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	US	374	117,868.37	0.20
138	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	US	342	117,861.28	0.20
139	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	US	320	117,850.64	0.20
140	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交易所	US	121	117,804.49	0.20
141	CME Group Inc	芝加哥商业交易所控股	CME UQ	纳斯达克交易所	US	207	117,768.84	0.20

		公司						
142	Sherwin-Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	US	70	117,695.36	0.20
143	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	US	320	117,655.01	0.20
144	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	US	1,087	117,625.05	0.20
145	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	US	392	117,621.75	0.20
146	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	US	341	117,474.96	0.19
147	DIRECTV	DIRECTV 公司	DTV UQ	纳斯达克交易所	US	207	117,427.16	0.19
148	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	US	405	117,424.71	0.19
149	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO UN	纽约交易所	US	148	117,408.51	0.19
150	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	US	953	117,399.16	0.19
151	Twenty-First Century Fox, Inc	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	US	590	117,390.60	0.19
152	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	US	374	117,273.89	0.19
153	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	US	275	117,249.68	0.19
154	Total System Services Inc	全系统服务公司	TSS UN	纽约交易所	US	459	117,212.57	0.19
155	W. W. Grainger Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	US	81	117,189.46	0.19
156	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	US	293	117,167.94	0.19
157	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ UN	纽约交易所	US	411	117,116.46	0.19
158	Kraft	卡夫食品集	KRFT UQ	纳斯达克交	US	225	117,115.18	0.19

	Foods Group Inc.	团股份有限 公司		易所				
159	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	US	273	117,081.25	0.19
160	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交易所	US	342	117,066.76	0.19
161	Clorox Co	Clorox 公 司	CLX UN	纽约交易所	US	184	117,012.35	0.19
162	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	US	285	117,000.55	0.19
163	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	US	607	116,895.09	0.19
164	Progressive Corp	Progressive 公 司	PGR UN	纽约交易所	US	687	116,887.20	0.19
165	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	US	456	116,808.89	0.19
166	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交 易所	US	44	116,769.52	0.19
167	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	US	283	116,767.74	0.19
168	Torchmark Corp	Torchmark 公 司	TMK UN	纽约交易所	US	328	116,746.28	0.19
169	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工 业股份有限 公司	MHK UN	纽约交易所	US	100	116,708.62	0.19
170	AbbVie Inc.	艾伯维有限 公司	ABBV UN	纽约交易所	US	284	116,659.47	0.19
171	Cablevision Systems Co A	有线电视系 统公司	CVC UN	纽约交易所	US	797	116,648.59	0.19
172	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	US	464	116,617.16	0.19
173	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	US	390	116,616.31	0.19
174	Hospira Inc	Hospira 公 司	HSP UN	纽约交易所	US	215	116,602.55	0.19
175	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	US	599	116,599.56	0.19
176	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交易所	US	263	116,587.15	0.19
177	AMETEK Inc	阿美特克股 份有限公司	AME UN	纽约交易所	US	348	116,546.25	0.19
178	Frontier Communications Corp	Frontier 通 信公司	FTR UQ	纳斯达克交 易所	US	3,851	116,540.19	0.19
179	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	US	304	116,530.11	0.19

180	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	US	245	116,441.46	0.19
181	Pall Corp	Pall 公司	PLL UN	纽约交易所	US	153	116,408.14	0.19
182	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	US	308	116,406.37	0.19
183	Perrigo Company plc	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	US	103	116,387.60	0.19
184	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	US	120	116,376.04	0.19
185	Nielsen NV	尼尔森控股公司	NLSN UN	纽约交易所	US	425	116,325.00	0.19
186	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	US	261	116,322.86	0.19
187	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	US	199	116,271.07	0.19
188	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	US	207	116,174.30	0.19
189	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	US	387	116,168.79	0.19
190	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	US	269	116,138.71	0.19
191	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	US	134	116,075.62	0.19
192	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	US	390	116,067.92	0.19
193	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	US	84	116,050.31	0.19
194	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	US	212	116,038.33	0.19
195	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	US	123	116,029.40	0.19
196	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	US	219	116,027.20	0.19
197	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	US	211	116,019.87	0.19
198	Starwood	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	US	234	116,005.93	0.19

	Hotel & Resort World							
199	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	US	429	116,003.54	0.19
200	Owens-Illinois Inc	Owens-Illinois 股份有限公司	OI UN	纽约交易所	US	827	115,983.43	0.19
201	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	US	378	115,963.01	0.19
202	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	US	162	115,956.41	0.19
203	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	US	186	115,953.11	0.19
204	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price	TROW UQ	纳斯达克交易所	US	244	115,951.27	0.19
205	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	US	269	115,941.37	0.19
206	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	US	1,430	115,924.86	0.19
207	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	US	342	115,895.88	0.19
208	Mallinckrodt plc	Mallinckrodt 公司	MNK UN	纽约交易所	US	161	115,870.57	0.19
209	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克交易所	US	182	115,829.49	0.19
210	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	US	597	115,827.04	0.19
211	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	US	281	115,822.27	0.19
212	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	US	811	115,821.91	0.19
213	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔工业公司	LYB UN	纽约交易所	US	183	115,817.02	0.19
214	Altera	Altera 公	ALTR UQ	纳斯达克交	US	370	115,816.04	0.19

	Corp	司		易所				
215	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	US	512	115,816.04	0.19
216	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	US	491	115,808.58	0.19
217	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	US	178	115,721.40	0.19
218	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	US	415	115,668.39	0.19
219	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	US	279	115,577.85	0.19
220	Moodys Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	US	175	115,504.24	0.19
221	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	US	106	115,461.57	0.19
222	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	US	580	115,418.65	0.19
223	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	US	309	115,405.27	0.19
224	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	US	226	115,355.93	0.19
225	Kimberly-Clark	金佰利	KMB UN	纽约交易所	US	178	115,318.76	0.19
226	L Brands Inc	L Brands 股份有限公司	LB UN	纽约交易所	US	220	115,306.16	0.19
227	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	US	402	115,215.44	0.19
228	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	US	215	115,169.83	0.19
229	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约交易所	US	179	115,167.75	0.19
230	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	US	368	115,122.51	0.19
231	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	US	209	115,099.04	0.19
232	Rockwell Automation	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	US	151	115,061.86	0.19

	Inc							
233	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	US	205	115,039.31	0.19
234	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	US	164	115,021.76	0.19
235	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	US	246	114,991.68	0.19
236	Affiliated Managers Grp	联合经理集团股份有限公司	AMG UN	纽约交易所	US	86	114,933.23	0.19
237	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	US	158	114,889.95	0.19
238	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	US	306	114,883.47	0.19
239	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈巴奥米特控股公司	ZBH UN	纽约交易所	US	172	114,859.63	0.19
240	Comerica Inc (MI)	Comerica 公司	CMA UN	纽约交易所	US	366	114,832.48	0.19
241	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	US	520	114,828.08	0.19
242	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	US	902	114,811.21	0.19
243	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	US	731	114,809.68	0.19
244	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	US	101	114,788.34	0.19
245	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交易所	US	520	114,764.50	0.19
246	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交易所	US	244	114,728.06	0.19
247	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	US	354	114,725.01	0.19
248	Zoetis Inc	硕腾公司	ZTS UN	纽约交易所	US	389	114,676.34	0.19
249	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交易所	US	465	114,594.24	0.19
250	Ameriprise Financial	阿默普莱斯金融公司	AMP UN	纽约交易所	US	150	114,565.81	0.19

	Inc							
251	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	US	382	114,504.43	0.19
252	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	US	122	114,504.30	0.19
253	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	US	225	114,446.59	0.19
254	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	US	223	114,424.52	0.19
255	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	US	639	114,424.03	0.19
256	H & R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	US	631	114,380.26	0.19
257	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	US	307	114,376.77	0.19
258	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	US	256	114,360.51	0.19
259	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	US	1,805	114,323.10	0.19
260	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交易所	US	482	114,304.63	0.19
261	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	US	293	114,301.88	0.19
262	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	US	357	114,300.42	0.19
263	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	US	221	114,290.02	0.19
264	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达克交易所	US	233	114,285.13	0.19
265	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	US	54	114,219.90	0.19
266	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	US	288	114,217.70	0.19
267	Philip Morris International	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	US	233	114,199.66	0.19

268	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	US	606	114,183.22	0.19
269	Charles Schwab Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	US	572	114,176.37	0.19
270	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交易所	US	200	114,128.68	0.19
271	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	US	141	114,096.65	0.19
272	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	US	200	114,067.55	0.19
273	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交易所	US	165	114,058.68	0.19
274	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达克交易所	US	473	114,049.94	0.19
275	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交易所	US	1,242	114,048.23	0.19
276	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	US	202	114,047.37	0.19
277	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	US	267	113,969.36	0.19
278	Monster Beverage Corp New	Monster Beverage 公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	US	139	113,888.91	0.19
279	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	US	488	113,877.78	0.19
280	Roper Technologies, Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	US	108	113,869.96	0.19
281	Parker-Hanifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	US	160	113,791.21	0.19
282	Joy Global Inc	久益环球股份有限公司	JOY UN	纽约交易所	US	514	113,754.53	0.19
283	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	US	705	113,743.22	0.19
284	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	US	621	113,706.54	0.19
285	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	US	1,239	113,697.00	0.19
286	MeadWestvaco Corp	美德维实伟克公司	MWV UN	纽约交易所	US	394	113,669.31	0.19

287	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	US	265	113,666.50	0.19
288	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交易所	US	89	113,604.81	0.19
289	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	US	170	113,586.41	0.19
290	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	US	619	113,567.40	0.19
291	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	US	109	113,551.56	0.19
292	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	US	473	113,442.68	0.19
293	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	US	249	113,410.34	0.19
294	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	US	218	113,404.96	0.19
295	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	US	114	113,365.95	0.19
296	Equinix Inc	Equinix 公司	EQIX UQ	纳斯达克交易所	US	73	113,358.37	0.19
297	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	US	186	113,349.08	0.19
298	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交易所	US	244	113,266.18	0.19
299	Salesforce .com	Salesforce .com 股份有限公司	CRM UN	纽约交易所	US	266	113,233.53	0.19
300	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	US	697	113,219.53	0.19
301	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	US	160	113,209.20	0.19
302	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交易所	US	190	113,207.98	0.19
303	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	US	446	113,129.36	0.19
304	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	US	642	113,116.52	0.19
305	Essex	埃塞克斯房	ESS UN	纽约交易所	US	87	113,025.18	0.19

	Property Trust	地产信托公司						
306	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	US	274	113,020.78	0.19
307	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	US	288	113,011.61	0.19
308	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	US	517	112,996.14	0.19
309	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交易所	US	333	112,988.50	0.19
310	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	US	138	112,976.76	0.19
311	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	US	312	112,958.79	0.19
312	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	US	334	112,796.90	0.19
313	Legg Mason Inc	美盛集团	LM UN	纽约交易所	US	358	112,782.10	0.19
314	Public Storage	Public Storage	PSA UN	纽约交易所	US	100	112,716.44	0.19
315	The Priceline Group Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达克交易所	US	16	112,624.25	0.19
316	NRG Energy	NRG 能源股份有限公司	NRG UN	纽约交易所	US	805	112,602.73	0.19
317	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond	BBBY UQ	纳斯达克交易所	US	267	112,598.21	0.19
318	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	US	217	112,526.55	0.19
319	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	US	174	112,525.21	0.19
320	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交易所	US	278	112,461.26	0.19
321	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	US	28	112,455.51	0.19
322	Alliance Data Systems Corp	Alliance Data Systems 公司	ADS UN	纽约交易所	US	63	112,442.68	0.19
323	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易所	US	468	112,415.16	0.19
324	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	US	226	112,385.33	0.19

325	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	US	418	112,262.45	0.19
326	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	US	688	112,178.20	0.19
327	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	US	224	112,171.35	0.19
328	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	437	112,128.87	0.19
329	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE UN	纽约交易所	US	187	112,072.13	0.19
330	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达克交易所	US	297	112,067.42	0.19
331	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	US	318	112,039.91	0.19
332	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	US	297	112,031.11	0.19
333	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	US	318	112,020.47	0.19
334	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	US	308	112,019.00	0.19
335	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	US	274	112,015.70	0.19
336	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	US	415	112,014.91	0.19
337	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约交易所	US	323	111,965.08	0.19
338	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	US	466	111,906.27	0.19
339	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克交易所	US	228	111,888.42	0.19
340	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	US	152	111,837.31	0.19
341	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	US	292	111,805.27	0.19
342	Goodyear	固特异轮胎	GT UQ	纳斯达克交	US	606	111,700.97	0.19

	Tire & Rubber Co	橡胶		易所				
343	Martin Marietta Materials	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM UN	纽约交易所	US	129	111,602.48	0.19
344	Endo International plc	Endo 制药 控股有限公司	ENDP UQ	纳斯达克交易所	US	229	111,511.15	0.19
345	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约交易所	US	259	111,504.61	0.19
346	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯 网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	US	279	111,501.24	0.19
347	Waters Corp	活德	WAT UN	纽约交易所	US	142	111,450.68	0.18
348	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交易所	US	171	111,431.91	0.18
349	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	US	164	111,422.32	0.18
350	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养 品公司	MJN UN	纽约交易所	US	202	111,416.94	0.18
351	Plum Creek Timber Co	Plum Creek 林业	PCL UN	纽约交易所	US	449	111,364.91	0.18
352	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	US	81	111,326.27	0.18
353	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	US	211	111,182.48	0.18
354	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交易所	US	359	111,165.73	0.18
355	McGraw Hill Financial Inc	麦格希	MHFI UN	纽约交易所	US	181	111,154.11	0.18
356	Biogen Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克交易所	US	45	111,128.74	0.18
357	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	US	353	111,120.61	0.18
358	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers 公司	TRV UN	纽约交易所	US	188	111,096.83	0.18

359	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	US	230	111,070.05	0.18
360	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	US	244	110,968.93	0.18
361	Chipotle Mexican Grill Inc.	Chipotle Mexican Grill 股份	CMG UN	纽约交易所	US	30	110,960.01	0.18
362	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	US	160	110,905.59	0.18
363	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	US	243	110,885.54	0.18
364	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交易所	US	463	110,874.48	0.18
365	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	US	282	110,855.46	0.18
366	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	393	110,773.97	0.18
367	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	US	697	110,662.82	0.18
368	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达克交易所	US	134	110,644.18	0.18
369	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	US	554	110,583.41	0.18
370	TEGNA Inc	TEGNA 股份有限公司	TGNA UN	纽约交易所	US	564	110,579.62	0.18
371	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	US	270	110,545.50	0.18
372	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	US	1,181	110,540.67	0.18
373	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	US	231	110,493.78	0.18
374	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	US	889	110,493.35	0.18
375	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	US	260	110,456.86	0.18
376	American Electric Power	美国电力	AEP UN	纽约交易所	US	341	110,428.55	0.18

377	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交易所	US	132	110,421.15	0.18
378	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	US	409	110,420.42	0.18
379	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	US	811	110,417.55	0.18
380	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交易所	US	148	110,387.16	0.18
381	Varian Medical Systems Inc	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	US	214	110,329.82	0.18
382	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	US	419	110,328.04	0.18
383	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	US	364	110,221.61	0.18
384	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	US	909	110,200.51	0.18
385	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	US	560	110,171.96	0.18
386	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	US	932	109,798.06	0.18
387	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克默伦股份有限公司	FCX UN	纽约交易所	US	964	109,737.16	0.18
388	Avago Technologies Ltd	安华高科技有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	US	135	109,711.91	0.18
389	Chevron Corp	雪佛龙德士古	CVX UN	纽约交易所	US	186	109,698.89	0.18
390	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	US	310	109,695.10	0.18
391	Noble Corp plc	Noble 股份有限公司	NE UN	纽约交易所	US	1,164	109,518.79	0.18
392	Viacom Inc B	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克交易所	US	277	109,465.72	0.18
393	Cardinal	Cardinal	CAH UN	纽约交易所	US	214	109,440.16	0.18

	Health Inc	Health 公司						
394	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	US	188	109,349.81	0.18
395	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	US	229	109,285.12	0.18
396	Fidelity National Information	富达国民信息服务公司	FIS UN	纽约交易所	US	289	109,190.12	0.18
397	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达克交易所	US	980	109,102.08	0.18
398	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	US	131	109,007.99	0.18
399	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	US	222	108,984.70	0.18
400	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	US	361	108,982.13	0.18
401	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	US	565	108,944.96	0.18
402	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	US	147	108,778.55	0.18
403	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	US	428	108,772.93	0.18
404	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	US	884	108,682.93	0.18
405	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	US	161	108,576.99	0.18
406	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	US	437	108,522.15	0.18
407	TECO Energy Inc	TECO 能源	TE UN	纽约交易所	US	1,005	108,506.01	0.18
408	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	US	203	108,431.48	0.18
409	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	309	108,321.13	0.18
410	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	US	373	108,317.71	0.18
411	Realty	Realty	O UN	纽约交易所	US	399	108,281.70	0.18

	Income Corp	Income 公司						
412	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	US	135	108,275.83	0.18
413	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	US	367	108,190.79	0.18
414	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	US	563	108,146.28	0.18
415	Simon Property Group	西蒙房地产集团公司	SPG UN	纽约交易所	US	102	107,893.06	0.18
416	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE UN	纽约交易所	US	447	107,890.12	0.18
417	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	US	335	107,850.63	0.18
418	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	US	159	107,830.88	0.18
419	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	US	476	107,672.72	0.18
420	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	US	110	107,511.94	0.18
421	Mylan NV	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	US	259	107,451.04	0.18
422	General Motors Company	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	US	527	107,384.83	0.18
423	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	US	523	107,337.15	0.18
424	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交易所	US	468	107,265.07	0.18
425	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	US	411	107,241.59	0.18
426	News Corporation	美国新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	US	1,202	107,215.30	0.18
427	Health Care REIT Inc	Health Care REIT 公司	HCN UN	纽约交易所	US	267	107,129.90	0.18
428	Molson	莫尔森-康	TAP UN	纽约交易所	US	251	107,124.39	0.18

	Coors Brewing Co B	胜						
429	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	US	842	107,122.62	0.18
430	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交易所	US	177	107,063.69	0.18
431	Centerpoint Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交易所	US	920	107,034.46	0.18
432	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交易所	US	333	106,982.80	0.18
433	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	US	311	106,873.74	0.18
434	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交易所	US	101	106,853.81	0.18
435	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	US	367	106,777.26	0.18
436	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES UN	纽约交易所	US	384	106,605.53	0.18
437	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	US	376	106,545.38	0.18
438	Allegheny Technologies Inc	冶联科技	ATI UN	纽约交易所	US	576	106,347.29	0.18
439	Keurig Green Mountain Inc	KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	GMCR UQ	纳斯达克交易所	US	227	106,346.13	0.18
440	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM UN	纽约交易所	US	771	106,244.22	0.18
441	General Growth Properties Inc	通用增长物 业公司	GGP UN	纽约交易所	US	677	106,204.36	0.18
442	CarMax Inc	CarMax 股 份有限公司	KMX UN	纽约交易所	US	262	106,052.74	0.18
443	Fossil Group Inc	化石集团	FOSL UQ	纳斯达克交易所	US	250	106,009.82	0.18
444	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交易所	US	430	105,942.57	0.18
445	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交易所	US	393	105,884.56	0.18

446	Transocean Ltd	Transocean 公司	RIG UN	纽约交易所	US	1,074	105,844.02	0.18
447	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST UQ	纳斯达克交易所	US	356	105,796.83	0.18
448	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	US	459	105,735.45	0.18
449	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	US	304	105,732.02	0.18
450	Diamond Offshore Drilling	钻石近海勘探公司	DO UN	纽约交易所	US	670	105,720.65	0.18
451	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	US	449	105,627.85	0.18
452	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	US	873	105,302.42	0.17
453	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	US	310	105,184.49	0.17
454	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交易所	US	124	105,161.75	0.17
455	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	US	245	105,102.87	0.17
456	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	US	169	105,055.61	0.17
457	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交易所	US	470	104,792.61	0.17
458	CenturyLink Inc	CenturyLink 公司	CTL UN	纽约交易所	US	583	104,717.04	0.17
459	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达克交易所	US	331	104,235.72	0.17
460	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	US	415	104,225.88	0.17
461	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	US	89	104,077.44	0.17
462	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	US	177	103,536.02	0.17
463	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	US	122	103,443.21	0.17
464	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	US	270	103,348.57	0.17
465	Vornado Realty Trust	沃那多房地产信托	VNO UN	纽约交易所	US	178	103,304.80	0.17
466	Iron	美国铁山公	IRM UN	纽约交易所	US	544	103,099.75	0.17

	Mountain Inc	司						
467	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	US	189	102,640.44	0.17
468	American Airlines Group Inc.	美国航空集团公司	AAL UQ	纳斯达克交易所	US	420	102,541.58	0.17
469	SanDisk Corp	SanDisk 公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	US	288	102,508.93	0.17
470	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	US	269	102,110.63	0.17
471	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	US	300	101,938.17	0.17
472	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	US	332	101,637.99	0.17
473	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	US	445	100,932.48	0.17
474	Kansas City Southern Inc	Kansas City Southern 公司	KSU UN	纽约交易所	US	181	100,918.42	0.17
475	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	US	1,479	100,818.46	0.17
476	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源公司	CNX UN	纽约交易所	US	756	100,479.71	0.17
477	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	US	230	99,736.66	0.17
478	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约交易所	US	148	99,429.88	0.17
479	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	US	1,455	99,360.37	0.16
480	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	US	513	98,980.90	0.16
481	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	US	206	98,762.27	0.16
482	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	257	98,026.87	0.16
483	E. I. du Pont de Nemours	杜邦	DD UN	纽约交易所	US	249	97,350.22	0.16

	and Company							
484	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	US	458	96,909.00	0.16
485	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	US	212	96,687.81	0.16
486	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	US	1,483	96,467.23	0.16
487	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交易所	US	165	96,203.92	0.16
488	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达克交易所	US	447	95,647.27	0.16
489	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR UQ	纳斯达克交易所	US	331	95,068.80	0.16
490	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	US	174	92,930.63	0.15
491	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	US	466	92,903.86	0.15
492	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	US	780	91,652.65	0.15
493	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	US	451	91,236.86	0.15
494	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	US	148	89,277.88	0.15
495	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	US	319	82,085.53	0.14
496	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	US	699	80,510.98	0.13
497	Discovery Communications Inc C	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达克交易所	US	415	78,854.44	0.13
498	Google Inc A	谷歌公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	US	19	62,730.18	0.10
499	Google Inc C	谷歌公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	US	19	60,461.61	0.10
500	Discovery Communications	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	US	212	43,107.73	0.07

	ions Inc A							
501	Gannett Co Inc	Gannett Co 公司	GCI UN	纽约交易所	US	282	24,119.25	0.04

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	Endo International plc	ENDP UQ	195,526.13	0.18
2	American Airlines Group Inc.	AAL UQ	182,454.57	0.17
3	Hanesbrands Inc	HBI UN	173,689.93	0.16
4	Henry Schein Inc	HSIC UQ	172,245.50	0.16
5	Skyworks Solutions Inc	SWKS UQ	170,702.57	0.16
6	SL Green Realty Corp	SLG UN	168,824.00	0.16
7	Equinix Inc	EQIX UQ	168,191.13	0.16
8	HCA Holdings Inc	HCA UN	166,795.17	0.16
9	Realty Income Corp	O UN	137,448.36	0.13
10	Qorvo, Inc	QRVO UQ	109,690.19	0.10
11	PVH Corp	PVH UN	47,432.19	0.04
12	Fossil Group Inc	FOSL UQ	46,945.08	0.04
13	Enesco PLC - CL A	ESV UN	46,504.03	0.04
14	Ralph Lauren Corp	RL UN	44,088.97	0.04
15	SanDisk Corp	SNDK UQ	43,379.53	0.04
16	Southwestern Energy Co	SWN UN	42,079.04	0.04
17	Frontier Communications Corp	FTR UQ	38,211.96	0.04
18	Keurig Green Mountain Inc	GMCR UQ	35,776.92	0.03
19	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	34,636.00	0.03
20	National Oilwell Varco Inc	NOV UN	33,856.89	0.03

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	Nabors Industries Ltd	NBR UN	262,887.05	0.25

2	Denbury Resources Inc	DNR UN	240,992.80	0.22
3	NetFlix Inc	NFLX UQ	218,954.65	0.20
4	Medtronic plc	MDT UN	210,011.84	0.20
5	Safeway Inc	SWY UN	205,907.43	0.19
6	PETSMART Inc	PETM UQ	205,846.22	0.19
7	Windstream Holdings Inc	WIN UQ	201,588.41	0.19
8	QEP Resources	QEP UN	200,465.20	0.19
9	ALLERGAN PLC	AGN UN	192,426.31	0.18
10	Newfield Exploration Co	NFX UN	173,539.50	0.16
11	Kraft Foods Group Inc.	KRFT UQ	165,577.44	0.15
12	Hospira Inc	HSP UN	163,942.59	0.15
13	Avon Products	AVP UN	162,070.16	0.15
14	Boston Scientific Corp	BSX UN	160,181.02	0.15
15	LyondellBasell Industries N.V.	LYB UN	157,045.55	0.15
16	Vulcan Materials Co	VMC UN	153,450.82	0.14
17	First Solar Inc	FSLR UQ	151,874.86	0.14
18	Avago Technologies Ltd	AVGO UQ	147,663.09	0.14
19	Electronic Arts	EA UQ	147,486.42	0.14
20	Mylan NV	MYL UQ	147,331.31	0.14

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	2,901,198.75
卖出收入（成交）总额	46,746,739.45

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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	111,393.34
3	应收股利	65,077.74
4	应收利息	601.78
5	应收申购款	126,670.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	103,629.45
8	其他	-
9	合计	407,373.00

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
3,523	12,106.44	31,352.67	0.07%	42,619,641.09	99.93%

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	115,681.57	0.2712%

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	0~10
	合计	0~10

§ 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	75,142,701.26
本报告期基金总申购份额	14,546,060.11
减：本报告期基金总赎回份额	47,037,767.61
本报告期末基金份额总额	42,650,993.76

§ 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

一、基金管理人的重大人事变动

1、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。

2、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。

3、基金管理人于 2015 年 5 月 5 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六次会议审议通过，刘明先生不再担任公司副总经理。

4、基金管理人于 2015 年 5 月 16 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七次会议审议通过，肖冰先生不再担任公司副总经理。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，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	49,503,725.01	100.00%	14,851.28	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	2015/1/15
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/16
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/21
4	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	2015/2/14
5	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/12
6	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
8	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	2015/3/31
9	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融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	2015/3/31
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/18
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2015 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8

12	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（2015 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
13	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/21
14	大成基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/27
15	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	2015/1/13
16	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/14
17	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（肖剑）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
18	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（钟鸣远）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/22
19	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通支付通道升级暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/28
20	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道升级暂停服务的更新公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/30
21	大成基金管理有限公司关于网上交易银联通银行通道恢复服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/2
22	大成基金管理有限公司关于调整网上直销基金转换及定投最低交易限额的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/13
23	大成基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/25
24	大成基金管理有限公司关于网上直销交易平台银联通富滇银行支付通道暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
25	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	2015/5/5
26	大成基金管理有限公司关于调整网上直销通联支付交易费率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
27	关于大成基金官方网站及交易系统升级维护的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/15
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	2015/5/16
29	大成基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理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	2015/5/19
30	关于在北京市开展打击以私募投资基金为名从事非法集资专项整治行动的通告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/24

§ 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办公住所。

12.3 查阅方式

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

大成基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日