

大成标普 500 等权重指数证券投资基金
2015 年年度报告
2015 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：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	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.....	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§ 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.....	39
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.....	70
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	71
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.....	71

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	71
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	71
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	72
8.11 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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的情况	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	76
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§ 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	34,272,035.33 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	北京市西城区复兴门内大街

	7088 号招商银行大厦 32 层	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业务部

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	14,360,385.22	12,629,863.89	5,397,706.62
本期利润	2,012,178.93	14,595,324.62	23,522,175.77
加权平均基金份额本期利润	0.0415	0.1489	0.2737
本期加权平均净值利润率	2.91%	11.06%	23.67%
本期基金份额净值增长率	2.35%	11.91%	27.26%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末

期末可供分配利润	15,070,365.27	13,996,093.01	4,220,695.34
期末可供分配基金份额利润	0.4397	0.1863	0.0480
期末基金资产净值	49,342,400.60	107,162,735.88	112,471,930.60
期末基金份额净值	1.440	1.426	1.279
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	46.51%	43.14%	27.90%

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）。

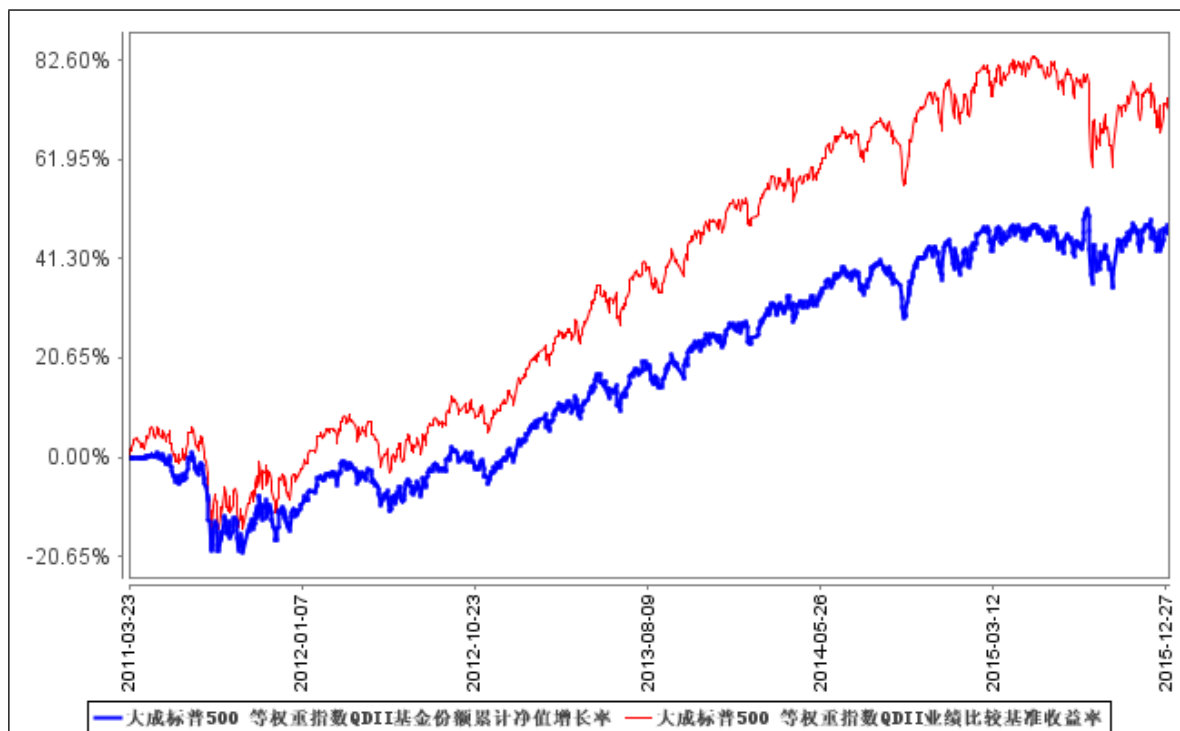
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.19%	1.09%	5.04%	1.18%	1.15%	-0.09%
过去六个月	1.91%	1.17%	-2.89%	1.22%	4.80%	-0.05%
过去一年	2.35%	1.00%	-2.20%	1.22%	4.55%	-0.22%
过去三年	45.78%	0.82%	52.45%	0.85%	-6.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	46.51%	1.03%	71.93%	1.09%	-25.42%	-0.06%

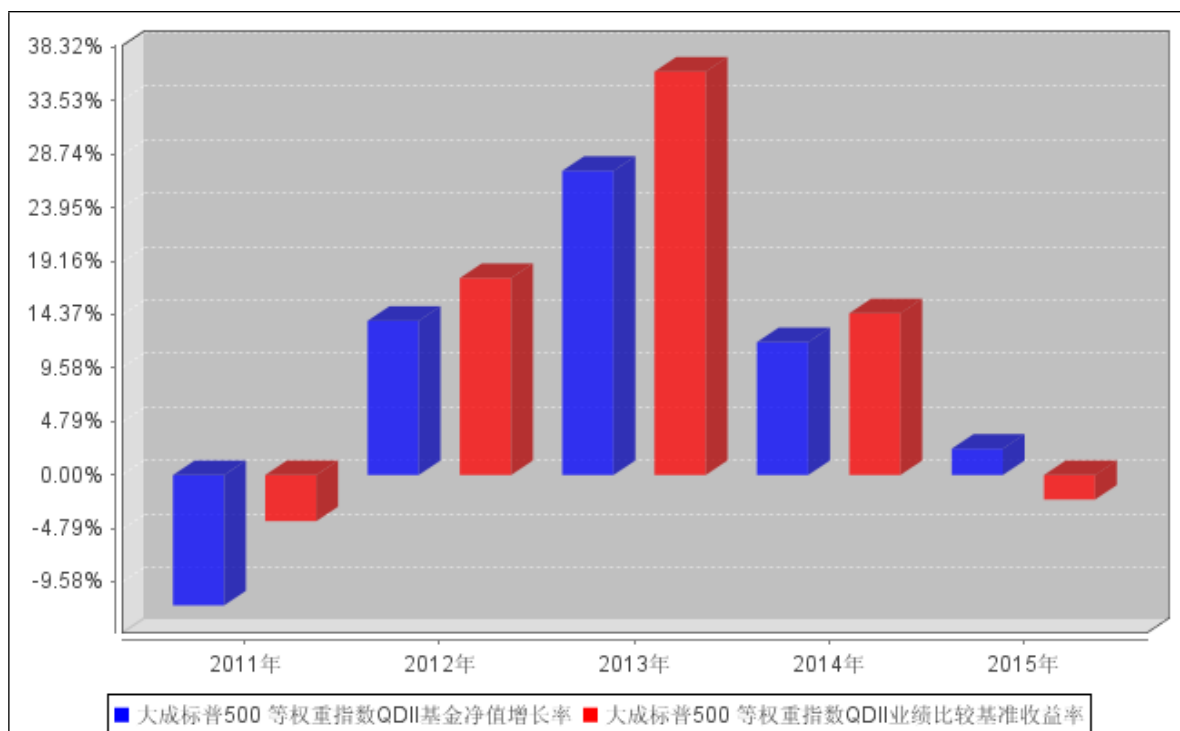
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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
2015	0.1870	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	
2014	0.0480	298,887.95	138,658.28	437,546.23	
2013	-	-	-	-	
合计	0.2350	1,035,843.71	749,380.84	1,785,224.55	

§ 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12月31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55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、大成景源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、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金和大成景辉灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冉凌浩 先生	本基金基金经理	2011年8月 26日	-	13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 等权重指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，大成标普 500 等权重指数证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，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 130 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 1 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 8 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

2015 年，全球发达国家宏观经济增长速度相对稳定，金融市场表现平稳。

2015 年，欧元区经济逐步回稳，这主要是因为欧元量化宽松政策成效已显现，促使欧元区经济企稳并出现复苏迹象。日本的量化宽松政策也取得了一定的效果，其宏观经济也出现了增长的趋势。

2015 年，美国宏观经济保持稳定增长，但增长速度稍弱于 2014 年，并且增长速度仍然低于潜在的经济增速。2015 年，美国 GDP 同比增长率为 1.8%，稍弱于 2014 年的 2.5% 的水平。美国宏观经济增速有所下降的原因主要在于：（1）新兴经济体宏观经济表现不佳，影响全球需求水平；（2）美国经济已经接近潜在产出水平，前期高速增长势头将放缓；（3）美元短期内过强对美国净出口造成负面影响；（4）国际原油价格快速下跌，导致能源行业景气度大幅下降。

2015 年 12 月份，美联储提高了联邦基金目标利率 25bp，这标志着美联储新一轮加息周期开启，也符合市场预期，同时美联储也暗示未来循序渐进的加息路径，未来加息进程仍旧取决于经济数据。当前美国通胀率仍然明显地低于 2% 的通胀目标，但通胀率在未来有望得以上升。

由于经济增速下降，标普 500 指数的企业盈利也没有增长，因此本基金所跟踪的标普 500 等权重指数点位在 2015 年出现了轻微下降。

2015 年，人民币兑美元汇率继续出现贬值的情形。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小量美元存款，因此美元兑人民币的升值有利于本基金净值的表现。

在本报告期内，本基金的目标指数下降 0.17%，美元兑人民币中间价上涨 6.02%，经汇率调整后的目标指数上涨 5.84%。在本报告期内，本基金净值上涨 2.35%，低于经汇率调整后的目标指数 3.49%。在本报告期内，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 3.67%，日均偏差绝对值

为 0.07%，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 1.440 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.35%，同期业绩比较基准收益率为-2.2%，高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

2016 年，全球宏观经济增长面临着不确定性，全球宏观经济增速可能会下降。首先，除中国以外的新兴市场经济体依然面临着宏观经济及金融风险，资源型国家尤为严重，这会对全球宏观经济增长造成严重的拖累；其次，欧洲和日本虽然采取了量化宽松政策，但是其经济增速仍然并不强劲；最后，中国经济增速面临进一步下调的可能，这也会对全球需求造成负面影响。

2016 年，美国经济有望延续温和增长的态势，但经济增速可能会持续低于潜在增长速度。经济增长的有利因素是国际经济竞争力强劲及国内需求较好，不利因素是全球需求较弱及美元保持强势。由于劳动力市场的持续好转及通胀可能的提升，美联储可能有 2 次左右的加息操作，但加息不会对宏观经济造成严重的负面影响。

2015 年本指数成分股企业盈利增速动力大幅减弱，进入 2016 年后，企业盈利有望恢复增长，但增速或许不会太高。

2016 年，美元相对于人民币有望继续保持升值的趋势，这将持续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，以期更好地跟踪指数，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。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。

4.9 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 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。

4.10 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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	<p>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：</p> <p>(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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）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；</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述大成标普 500 等权重指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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	2016 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,474,764.33	6,140,744.45
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	46,407,281.66	100,813,207.70
其中：股票投资		46,407,281.66	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	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	103.07	882.47
应收股利		63,306.30	131,104.65
应收申购款		75,726.80	191,659.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,021,182.16	109,956,931.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		485,477.48	2,330,061.59
应付管理人报酬		42,137.38	93,503.94
应付托管费		10,534.34	23,375.99
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	140,632.36	347,254.11
负债合计		678,781.56	2,794,195.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	34,272,035.33	75,142,701.26
未分配利润	7.4.7.10	15,070,365.27	32,020,034.62
所有者权益合计		49,342,400.60	107,162,735.88
负债和所有者权益总计		50,021,182.16	109,956,931.51

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.440 元，基金份额总额 34,272,035.33 份。

7.2 利润表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		3,463,694.60	16,828,409.75
1. 利息收入		20,704.56	37,687.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	20,704.56	37,687.01
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）		14,999,608.01	14,957,914.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,260,791.11	12,683,498.80
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	7.4.7.14.5	-	-
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	1,738,816.90	2,274,415.98

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-12,348,206.29	1,965,460.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		724,786.69	-277,508.14
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	66,801.63	144,855.37
减：二、费用		1,451,515.67	2,233,085.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	697,978.35	1,316,479.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	174,494.58	329,119.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	21,542.87	31,711.33
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	557,499.87	555,774.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,012,178.93	14,595,324.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,012,178.93	14,595,324.62

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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）	-	2,012,178.93	2,012,178.93
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）	-40,870,665.93	-17,614,169.96	-58,484,835.89
其中：1. 基金申购款	20,915,768.64	8,862,456.81	29,778,225.45
2. 基金赎回款	-61,786,434.57	-26,476,626.77	-88,263,061.34
四、本期向基金份额持	-	-1,347,678.32	-1,347,678.32

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）	34,272,035.33	15,070,365.27	49,342,400.60
项目	上年度可比期间 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、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,804,137.07	-6,662,836.04	-19,466,973.11
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

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：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</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

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 2016 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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协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 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	3,474,764.33	6,140,744.45
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,474,764.33	6,140,744.45

注：于 2015 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 460,495.37 元，折合人民币 2,990,272.73 元(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)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,656,532.80	46,407,281.66	7,750,748.86
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	38,656,532.80	46,407,281.66	7,750,748.86
项目	上年度末 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

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	103.07	882.47
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	103.07	882.47

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付赎回费	632.36	7,254.11
预提信息披露费	100,000.00	300,000.00
预提审计费	40,000.00	40,000.00
合计	140,632.36	347,254.11

7.4.7.9 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 12 月 31 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	20,915,768.64	20,915,768.64
本期赎回（以“-”号填列）	-61,786,434.57	-61,786,434.57
本期末	34,272,035.33	34,272,035.33

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	13,996,093.01	18,023,941.61	32,020,034.62
本期利润	14,360,385.22	-12,348,206.29	2,012,178.93
本期基金份额交易产生的变动数	-11,484,281.94	-6,129,888.02	-17,614,169.96
其中：基金申购款	5,819,473.86	3,042,982.95	8,862,456.81
基金赎回款	-17,303,755.80	-9,172,870.97	-26,476,626.77
本期已分配利润	-1,347,678.32	-	-1,347,678.32
本期末	15,524,517.97	-454,152.70	15,070,365.27

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
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	20,580.25	37,482.42
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	124.31	204.59
合计	20,704.56	37,687.01

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
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	61,693,720.34	60,618,577.24
卖出股票成本总额	48,432,929.23	47,935,078.44
买卖股票差价收入	13,260,791.11	12,683,498.80

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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
股票投资产生的股利收益	1,738,816.90	2,274,415.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,738,816.90	2,274,415.98

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,348,206.29	1,965,460.73
——股票投资	-12,348,206.29	1,965,460.73
——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	-12,348,206.29	1,965,460.73

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
基金赎回费收入	66,801.63	139,250.59
其他	-	5,604.78
合计	66,801.63	144,855.37

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 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
交易所市场交易费用	21,542.87	31,711.33
银行间市场交易费用	-	-
合计	21,542.87	31,711.33

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	12,337.54	2,846.89
银行划款手续费	2,974.63	11,367.18
指数使用费	202,187.70	201,560.70
合计	557,499.87	555,774.77

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 2016 年 1 月 20 日宣告 2015 年度第 1 次分红，向截至 2016 年 1 月 21 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 0.440 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	697,978.35	1,316,479.25
其中：支付销售机构的客户维护费	258,372.99	483,146.16

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 1.00% 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 1.00% / 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	174,494.58	329,119.78

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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	484,515.95	20,580.25	3,745,638.00	37,482.42
中银香港	2,990,248.38	-	2,395,106.45	-

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

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	2015 年 1 月 20 日	2015 年 1 月 19 日	0.1870	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	
合计	-	-	0.1870	736,955.76	610,722.56	1,347,678.32	

7.4.12 期末（2015 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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2014 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 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	3,474,764.33	-	-	-	3,474,764.33
交易性金融资产	-	-	-	46,407,281.66	46,407,281.66
应收利息	-	-	-	103.07	103.07
应收股利	-	-	-	63,306.30	63,306.30
应收申购款	4,220.97	-	-	71,505.83	75,726.80
资产总计	3,478,985.30	-	-	46,542,196.86	50,021,182.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	485,477.48	485,477.48
应付管理人报酬	-	-	-	42,137.38	42,137.38
应付托管费	-	-	-	10,534.34	10,534.34
其他负债	-	-	-	140,632.36	140,632.36
负债总计	-	-	-	678,781.56	678,781.56
利率敏感度缺口	3,478,985.30	-	-	45,863,415.30	49,342,400.60
上年度末	1 年以内	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计

2014 年 12 月 31 日		5 年			
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 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）。

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 2015 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	2,990,272.73	-	-	2,990,272.73
交易性金融资产	46,407,281.66	-	-	46,407,281.66
应收股利	63,306.30	-	-	63,306.30
应收利息	0.45	-	-	0.45
资产合计	49,460,861.14	-	-	49,460,861.14
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	49,460,861.14	-	-	49,460,861.14
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

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 247	增加约 530
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 247	减少约 530

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 2015 年 12 月 31 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	46,407,281.66	94.05	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	46,407,281.66	94.05	100,813,207.70	94.07

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%		增加约 231
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%		减少约 231	减少约 515

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 2015 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 46,407,281.66 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 100,813,207.70 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 2015 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(2014 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	46,407,281.66	92.78
	其中：普通股	46,407,281.66	92.78
	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	3,474,764.33	6.95
8	其他各项资产	139,136.17	0.28
9	合计	50,021,182.16	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	46,407,281.66	94.05
合计	46,407,281.66	94.05

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	8,254,942.52	16.73
消费者非必需品	7,634,387.05	15.47
信息技术	6,315,752.59	12.80
工业	6,057,403.71	12.28
医疗保健	5,279,363.75	10.70
能源	3,690,992.88	7.48
消费者常用品	3,463,099.58	7.02
公用事业	2,803,486.94	5.68
基础材料	2,428,120.54	4.92
电信服务	479,732.10	0.97
合计	46,407,281.66	94.05

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	First Solar Inc	福思第一太阳 能公司	FSLR UQ	纳斯达 克交易 所	美国	272	116,555.44	0.24
2	ONEOK Inc	Oneok 股份有 限公司	OKE UN	纽约交 易所	美国	705	112,893.18	0.23
3	Southwest ern Energy Co	西南能源公司	SWN UN	纽约交 易所	美国	2,429	112,145.71	0.23
4	NRG Energy	NRG 能源股份 有限公司	NRG UN	纽约交 易所	美国	1,413	107,995.13	0.22
5	Royal Caribbean Cruises	皇家加勒比海 游轮有限公司	RCL UN	纽约交 易所	美国	164	107,783.63	0.22
6	PerkinElme r Inc	珀金埃尔默	PKI UN	纽约交 易所	美国	303	105,402.23	0.21
7	CONSOL Energy Inc	CONSOL 能源 公司	CNX UN	纽约交 易所	美国	2,050	105,163.85	0.21
8	GenenalGro wthPropert iesIn	通用增长物业 公司	GGP UN	纽约交 易所	美国	589	104,070.91	0.21
9	Cigna Corporatio n	CIGNA 公司	CI UN	纽约交 易所	美国	109	103,572.73	0.21
10	Simon Property Group	西蒙房地产集 团公司	SPG UN	纽约交 易所	美国	82	103,534.48	0.21
11	Eversource Energy	Eversource 能 源公司	ES UN	纽约交 易所	美国	312	103,467.98	0.21
12	Apartment Investment & Mgmt	公寓投资与管 理	AIV UN	纽约交 易所	美国	398	103,455.65	0.21
13	HCP Inc	HCP 公司	HCP UN	纽约交 易所	美国	415	103,050.83	0.21
14	Tesoro Corp	特索罗公司	TSO UN	纽约交 易所	美国	150	102,634.59	0.21
15	Wisconsin Energy	WEC 能源集团 股份有限公司	WEC UN	纽约交 易所	美国	308	102,621.48	0.21

	Corp							
16	Health Care REIT Inc	Welltower 股份有限公司	HCN UN	纽约交易所	美国	232	102,488.23	0.21
17	Southern Co	南方	SO UN	纽约交易所	美国	337	102,392.58	0.21
18	Hewlett Packard Enterprise	Hewlett Packard Enterprise C	HPE UN	纽约交易所	美国	1,037	102,354.72	0.21
19	Waters Corp	活德	WAT UN	纽约交易所	美国	117	102,247.32	0.21
20	Reynolds American Inc	雷诺兹美国	RAI UN	纽约交易所	美国	341	102,190.76	0.21
21	Rockwell Collins	罗克威尔克林斯	COL UN	纽约交易所	美国	170	101,891.08	0.21
22	Waste Management Inc	废品管理	WM UN	纽约交易所	美国	294	101,889.65	0.21
23	Macerich Co	Macerich 公司	MAC UN	纽约交易所	美国	194	101,649.91	0.21
24	Honeywell Intl Inc	霍尼韦尔	HON UN	纽约交易所	美国	151	101,553.86	0.21
25	Microchip Technology Inc	Microchip 科技股份有限公司	MCHP UQ	纳斯达克交易所	美国	336	101,543.28	0.21
26	Carnival Corp	嘉年华公司	CCL UN	纽约交易所	美国	287	101,532.37	0.21
27	Alcoa Inc	美铝	AA UN	纽约交易所	美国	1,584	101,521.46	0.21
28	American Intl Group Inc	美国国际集团	AIG UN	纽约交易所	美国	252	101,406.91	0.21
29	Amgen Inc	安进	AMGN UQ	纳斯达克交易所	美国	96	101,194.18	0.21
30	Helmerich & Payne Inc	Helmerich & Payne Inc	HP UN	纽约交易所	美国	291	101,190.09	0.21
31	Wynn Resorts Ltd	永利度假村有限公司	WYNN UQ	纳斯达克交易所	美国	225	101,090.74	0.20
32	American Electric	美国电力	AEP UN	纽约交易所	美国	267	101,028.01	0.20

	Power							
33	DTE Energy Co	DTE 能源	DTE UN	纽约交易所	美国	194	101,020.03	0.20
34	Cabot Oil & Gas A	卡伯特石油天然气公司	COG UN	纽约交易所	美国	879	100,972.30	0.20
35	Charles Schwab Corp	嘉信理财	SCHW UN	纽约交易所	美国	472	100,929.77	0.20
36	PayPal Holdings Inc.	Paypal 控股股份有限公司	PYPL UQ	纳斯达克交易所	美国	429	100,844.31	0.20
37	Ford Motor Co	福特汽车	F UN	纽约交易所	美国	1,102	100,827.30	0.20
38	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油	XOM UN	纽约交易所	美国	199	100,729.05	0.20
39	Range Resources Corp	Range 资源公司	RRC UN	纽约交易所	美国	630	100,678.72	0.20
40	Chesapeake Energy Corp	切萨皮克能源公司	CHK UN	纽约交易所	美国	3,445	100,667.03	0.20
41	Duke Energy Corp	杜克能源	DUK UN	纽约交易所	美国	217	100,596.45	0.20
42	Pinnacle West Capital (AZ)	Pinnacle 西部资本	PNW UN	纽约交易所	美国	240	100,489.76	0.20
43	SunTrust Banks Inc (GA)	SunTrust 银行	STI UN	纽约交易所	美国	361	100,425.08	0.20
44	Cardinal Health Inc	Cardinal Health	CAH UN	纽约交易所	美国	173	100,285.28	0.20
45	Mattel Inc	美泰	MAT UQ	纳斯达克交易所	美国	568	100,212.87	0.20
46	IntercontinentalExchange	洲际交易所 (ICE)	ICE UN	纽约交易所	美国	60	99,843.00	0.20
47	Peoples United Financial Inc	Peoples United Financial 股	PBCT UQ	纳斯达克交易所	美国	952	99,837.80	0.20
48	Mallinckrodt	Mallinckrodt	MNK UN	纽约交	美国	206	99,831.18	0.20

	dt PLC	公司		易所				
49	Quest Diagnostic s	Quest Diagnostics	DGX UN	纽约交 易所	美国	216	99,782.22	0.20
50	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	80	99,713.12	0.20
51	Zoetis Inc When Issued	硕腾公司	ZTS UN	纽约交 易所	美国	320	99,575.46	0.20
52	Lam Research Corp	Lam Research 公司	LRCX UQ	纳斯达 克交易 所	美国	193	99,534.29	0.20
53	Ecolab Inc	艺康化工	ECL UN	纽约交 易所	美国	134	99,526.89	0.20
54	Symantec Corp	赛门铁克	SYMC UQ	纳斯达 克交易 所	美国	729	99,410.52	0.20
55	Fastenal Co	快扣公司	FAST UQ	纳斯达 克交易 所	美国	375	99,400.78	0.20
56	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术 公司	ISRG UQ	纳斯达 克交易 所	美国	28	99,303.25	0.20
57	Expedia	艾派迪公司	EXPE UQ	纳斯达 克交易 所	美国	123	99,280.00	0.20
58	Mastercard Inc A	万事达股份有 限公司	MA UN	纽约交 易所	美国	157	99,258.05	0.20
59	Kimberly- Clark	金佰利	KMB UN	纽约交 易所	美国	120	99,196.23	0.20
60	NextEra Energy Inc	新纪元能源公 司	NEE UN	纽约交 易所	美国	147	99,169.16	0.20
61	Monsanto Co.	孟山都	MON UN	纽约交 易所	美国	155	99,161.17	0.20
62	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ UN	纽约交 易所	美国	456	99,137.01	0.20
63	PNC Finl Services Group	PNC 财务服务	PNC UN	纽约交 易所	美国	160	99,024.80	0.20
64	Starbucks Corp	星巴克	SBUX UQ	纳斯达 克交易 所	美国	254	99,011.95	0.20
65	TECO	TECO 能源	TE UN	纽约交	美国	572	98,987.14	0.20

	Energy Inc			易所				
66	XL Group Plc	XL 集团公司	XL UN	纽约交易所	美国	389	98,969.09	0.20
67	McCormick & Co	味好美	MKC UN	纽约交易所	美国	178	98,895.45	0.20
68	Vertex Pharmaceuticals Inc	维特制药股份有限公司	VRTX UQ	纳斯达克交易所	美国	121	98,867.85	0.20
69	Baxter Intl Inc	百特	BAX UN	纽约交易所	美国	399	98,844.61	0.20
70	AllianceData Systems Corp	联合数据系统公司	ADS UN	纽约交易所	美国	55	98,776.42	0.20
71	Regeneron Pharmaceuticals	再生元制药股份有限公司	REGN UQ	纳斯达克交易所	美国	28	98,705.06	0.20
72	Bank of America Corp	美国银行	BAC UN	纽约交易所	美国	903	98,686.42	0.20
73	JP Morgan Chase & Co	摩根大通	JPM UN	纽约交易所	美国	230	98,617.65	0.20
74	Nasdaq OMX Group/The	纳斯达克股份有限公司	NDAQ UQ	纳斯达克交易所	美国	261	98,588.24	0.20
75	Noble Energy Inc	Noble 能源股份有限公司	NBL UN	纽约交易所	美国	461	98,577.59	0.20
76	CBRE Group Inc.	世邦魏理仕	CBG UN	纽约交易所	美国	439	98,576.87	0.20
77	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR UN	纽约交易所	美国	269	98,570.71	0.20
78	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O UN	纽约交易所	美国	294	98,567.78	0.20
79	Discover Financial Services	Discover 金融服务公司	DFS UN	纽约交易所	美国	283	98,536.87	0.20
80	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED UN	纽约交易所	美国	236	98,493.11	0.20
81	Eli Lilly & Co	礼来	LLY UN	纽约交易所	美国	180	98,487.13	0.20
82	Huntington Bancshares (OH)	杭庭顿银行	HBAN UQ	纳斯达克交易所	美国	1,371	98,464.15	0.20

83	Cablevisio n Systems Co A	有线电视系统 公司	CVC UN	纽约交 易所	美国	475	98,394.27	0.20
84	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB UN	纽约交 易所	美国	125	98,361.81	0.20
85	AT&T Inc	美国电话电报 公司	T UN	纽约交 易所	美国	440	98,315.70	0.20
86	Progressiv e Corp	Progressive 公司	PGR UN	纽约交 易所	美国	476	98,292.32	0.20
87	Loews Corp	罗斯	L UN	纽约交 易所	美国	394	98,245.57	0.20
88	Sysco Corp	Sysco 公司	SYU UN	纽约交 易所	美国	369	98,241.67	0.20
89	Level 3 Communicat ions	Level 3 通信 股份有限公司	LVLN UN	纽约交 易所	美国	278	98,131.80	0.20
90	Mondelez Internatio nal Inc	Mondelez 国际 公司	MDLZ UQ	纳斯达 克交易 所	美国	337	98,125.31	0.20
91	Spectra Energy Corp	光谱能源公司	SE UN	纽约交 易所	美国	631	98,093.23	0.20
92	AFLAC Inc	家庭人寿保险	AFL UN	纽约交 易所	美国	252	98,019.59	0.20
93	Metlife Inc	大都会集团	MET UN	纽约交 易所	美国	313	97,986.67	0.20
94	Red Hat Inc	红帽公司	RHT UN	纽约交 易所	美国	182	97,867.77	0.20
95	SCANA Corp	美国 SCANA 公司	SCG UN	纽约交 易所	美国	249	97,806.67	0.20
96	Centerpoi nt Energy Inc	中点能源	CNP UN	纽约交 易所	美国	820	97,762.45	0.20
97	Thermo Fisher Scientific	Thermo Fisher Scientific 公 司	TMO UN	纽约交 易所	美国	106	97,638.42	0.20
98	Harris Corp	哈里斯公司	HRS UN	纽约交 易所	美国	173	97,622.83	0.20
99	TJX Cos Inc	TJX 公司	TJX UN	纽约交 易所	美国	212	97,617.77	0.20
100	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC UQ	纳斯达 克交易 所	美国	95	97,586.15	0.20

101	EMC Corp	EMC 公司	EMC UN	纽约交易所	美国	585	97,552.05	0.20
102	US Bancorp	美国合众银行	USB UN	纽约交易所	美国	352	97,532.83	0.20
103	Jacobs Engineering Group Inc	雅各布工程集团	JEC UN	纽约交易所	美国	358	97,521.53	0.20
104	Cisco Systems Inc	思科	CSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	553	97,512.57	0.20
105	Fluor Corp	福陆	FLR UN	纽约交易所	美国	318	97,507.64	0.20
106	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI UN	纽约交易所	美国	207	97,506.47	0.20
107	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	美国	364	97,430.49	0.20
108	Wells Fargo & Co	富国银行	WFC UN	纽约交易所	美国	276	97,425.82	0.20
109	Allergan Inc	眼力健有限公司	AGN UN	纽约交易所	美国	48	97,404.00	0.20
110	Fifth Third Bancorp (OH)	五三银行	FITB UQ	纳斯达克交易所	美国	746	97,368.93	0.20
111	Pitney Bowes Inc	Pitney Bowes 公司	PBI UN	纽约交易所	美国	726	97,351.40	0.20
112	Coach Inc	Coach 公司	COH UN	纽约交易所	美国	458	97,341.27	0.20
113	The Kraft Heinz Company	卡夫亨氏公司	KHC UQ	纳斯达克交易所	美国	206	97,329.71	0.20
114	Nisource Inc	NiSource 公司	NI UN	纽约交易所	美国	768	97,298.02	0.20
115	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	BLK UN	纽约交易所	美国	44	97,292.83	0.20
116	Lab Corp of America Hldgs	美国实验控股	LH UN	纽约交易所	美国	121	97,147.11	0.20
117	BB&T Corp	BB&T 公司	BBT UN	纽约交	美国	395	96,981.59	0.20

				易所				
118	Emerson Electric Co	艾默生电气	EMR UN	纽约交易所	美国	312	96,903.73	0.20
119	Delphi Automotive PLC	德尔福汽车公司	DLPH UN	纽约交易所	美国	174	96,865.16	0.20
120	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB UN	纽约交易所	美国	81	96,848.99	0.20
121	Hershey Foods Corp	好时食品	HSY UN	纽约交易所	美国	167	96,807.17	0.20
122	Scripps Networks Interactive	斯克利普斯网络互动公司	SNI UN	纽约交易所	美国	270	96,798.15	0.20
123	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN UQ	纳斯达克交易所	美国	401	96,788.21	0.20
124	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI UQ	纳斯达克交易所	美国	385	96,776.39	0.20
125	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR UN	纽约交易所	美国	218	96,770.74	0.20
126	Interpublic Group Cos	Interpublic 集团	IPG UN	纽约交易所	美国	640	96,749.45	0.20
127	Kimco Realty Corp	Kimco 房地产公司	KIM UN	纽约交易所	美国	563	96,735.03	0.20
128	Sealed Air Corp	希悦尔包装	SEE UN	纽约交易所	美国	334	96,731.26	0.20
129	Estee Lauder Cos.	雅诗兰黛	EL UN	纽约交易所	美国	169	96,638.66	0.20
130	FirstEnergy Corp	第一能源	FE UN	纽约交易所	美国	469	96,633.66	0.20
131	Pfizer Inc	辉瑞制药	PFE UN	纽约交易所	美国	461	96,631.78	0.20
132	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN UQ	纳斯达克交易所	美国	22	96,557.10	0.20
133	Varian Medical	瓦里安医疗设备有限公司	VAR UN	纽约交易所	美国	184	96,541.65	0.20

	Systems Inc							
134	Abbott Laboratories	雅培制药	ABT UN	纽约交易所	美国	331	96,528.73	0.20
135	Paychex Inc	Paychex 公司	PAYX UQ	纳斯达克交易所	美国	281	96,508.47	0.20
136	Genuine Parts Co	原配部件	GPC UN	纽约交易所	美国	173	96,488.21	0.20
137	ProLogis Inc	普洛斯公司	PLD UN	纽约交易所	美国	346	96,432.04	0.20
138	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	纽约交易所	美国	182	96,425.93	0.20
139	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME UN	纽约交易所	美国	277	96,393.79	0.20
140	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	纽约交易所	美国	62	96,387.23	0.20
141	Chevron Corp	雪佛龙德士古	CVX UN	纽约交易所	美国	165	96,387.10	0.20
142	ACE Limited	ACE 公司	ACE UN	纽约交易所	美国	127	96,364.70	0.20
143	AmerisourceBergen Corp	美源伯根	ABC UN	纽约交易所	美国	143	96,303.53	0.20
144	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE UN	纽约交易所	美国	343	96,286.39	0.20
145	CA Inc	冠群国际	CA UQ	纳斯达克交易所	美国	519	96,252.30	0.20
146	Equinix Inc	Equinix 公司	EQIX UQ	纳斯达克交易所	美国	49	96,219.57	0.20
147	AbbVie Inc	艾伯维有限公司	ABBV UN	纽约交易所	美国	250	96,170.22	0.19
148	Roper Industries Inc	Roper 科技股份有限公司	ROP UN	纽约交易所	美国	78	96,128.79	0.19
149	TE Connectivity Ltd.	泰科电子公司	TEL UN	纽约交易所	美国	229	96,077.29	0.19
150	Vornado	沃那多房地产	VNO UN	纽约交	美国	148	96,066.84	0.19

	Realty Trust	信托		易所				
151	H & R Block Inc	H&R Block 公司	HRB UN	纽约交易所	美国	444	96,038.01	0.19
152	Berkshire Hathaway B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B UN	纽约交易所	美国	112	96,030.47	0.19
153	Northern Trust Corp (IL)	北美信托	NTRS UQ	纳斯达克交易所	美国	205	95,965.34	0.19
154	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO UN	纽约交易所	美国	209	95,964.95	0.19
155	Marathon Petroleum Corp.	马拉松石油公司	MPC UN	纽约交易所	美国	285	95,939.04	0.19
156	Weyerhaeuser Co	惠好	WY UN	纽约交易所	美国	492	95,781.64	0.19
157	Marsh & McLennan Companies	Marsh & McLennan	MMC UN	纽约交易所	美国	266	95,778.65	0.19
158	TripAdvisor Inc.	TripAdvisor 公司	TRIP UQ	纳斯达克交易所	美国	173	95,769.24	0.19
159	PPL Corp	PPL 公司	PPL UN	纽约交易所	美国	432	95,742.68	0.19
160	Patterson Cos Inc	帕特森公司	PDCO UQ	纳斯达克交易所	美国	326	95,705.66	0.19
161	Celgene Corp	新基医药	CELG UQ	纳斯达克交易所	美国	123	95,653.84	0.19
162	Dr Pepper Snapple Group	Dr Pepper Snapple 集团公司	DPS UN	纽约交易所	美国	158	95,622.16	0.19
163	Xcel Energy Inc	Xcel 能源	XEL UN	纽约交易所	美国	410	95,605.92	0.19
164	Kohls Corp	Kohls 公司	KSS UN	纽约交易所	美国	309	95,570.66	0.19
165	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A UN	纽约交易所	美国	352	95,567.09	0.19
166	Intl Flavors & Fragrances	国际香料	IFF UN	纽约交易所	美国	123	95,558.00	0.19

167	Mylan Inc.	迈兰公司	MYL UQ	纳斯达克交易所	美国	272	95,501.63	0.19
168	Biogen Idec Inc	百健	BIIB UQ	纳斯达克交易所	美国	48	95,487.09	0.19
169	Aetna Inc	安泰保险	AET UN	纽约交易所	美国	136	95,483.97	0.19
170	Microsoft Corp	微软	MSFT UQ	纳斯达克交易所	美国	265	95,470.21	0.19
171	D.R. Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI UN	纽约交易所	美国	459	95,467.41	0.19
172	EQT Corporation	EQT 公司	EQT UN	纽约交易所	美国	282	95,460.21	0.19
173	United Technologies Corp	联合技术	UTX UN	纽约交易所	美国	153	95,447.54	0.19
174	OReilly Automotive	OReilly 汽车股份有限公司	ORLY UQ	纳斯达克交易所	美国	58	95,445.27	0.19
175	Harman Intl Industries Inc	哈曼国际工业公司	HAR UN	纽约交易所	美国	156	95,434.88	0.19
176	Edison Intl	爱迪生国际	EIX UN	纽约交易所	美国	248	95,352.54	0.19
177	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	YUM UN	纽约交易所	美国	201	95,345.85	0.19
178	Xerox Corp	施乐	XRX UN	纽约交易所	美国	1,381	95,326.24	0.19
179	Constellation Brands Inc A	星座公司	STZ UN	纽约交易所	美国	103	95,269.68	0.19
180	CSRA Inc	CSRA Inc	CSRA UN	纽约交易所	美国	489	95,261.11	0.19
181	Dollar General Corp	达乐公司	DG UN	纽约交易所	美国	204	95,205.79	0.19
182	Adobe Systems Inc	奥多比	ADBE UQ	纳斯达克交易所	美国	156	95,161.37	0.19
183	Facebook	Facebook 公司	FB UQ	纳斯达克	美国	140	95,146.82	0.19

	Inc			克交易所				
184	Linear Technology Corp	凌特	LLTC UQ	纳斯达克交易所	美国	345	95,145.20	0.19
185	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS UN	纽约交易所	美国	406	95,121.37	0.19
186	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI UN	纽约交易所	美国	214	95,120.20	0.19
187	Frontier Communications Corp	Frontier 通信公司	FTR UQ	纳斯达克交易所	美国	3,136	95,099.55	0.19
188	KLA-Tencor Corporation	Kla-Tencor 公司	KLAC UQ	纳斯达克交易所	美国	211	95,019.87	0.19
189	Apache Corp	阿帕契	APA UN	纽约交易所	美国	329	95,005.46	0.19
190	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL UN	纽约交易所	美国	185	95,000.07	0.19
191	Eaton Corp plc	伊顿	ETN UN	纽约交易所	美国	281	94,957.47	0.19
192	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	纽约交易所	美国	59	94,899.42	0.19
193	Procter & Gamble	宝洁	PG UN	纽约交易所	美国	184	94,880.85	0.19
194	Analog Devices Inc	模拟器件	ADI UQ	纳斯达克交易所	美国	264	94,835.65	0.19
195	Ralph Lauren Corp	Ralph Lauren 公司	RL UN	纽约交易所	美国	131	94,831.76	0.19
196	Omnicom Group	奥姆尼康	OMC UN	纽约交易所	美国	193	94,822.01	0.19
197	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT UQ	纳斯达克交易所	美国	782	94,806.17	0.19
198	Western Union Co	西联汇款	WU UN	纽约交易所	美国	815	94,784.81	0.19
199	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK UN	纽约交易所	美国	74	94,774.22	0.19
200	Philip Morris Internatio	菲利普莫里斯国际集团公司	PM UN	纽约交易所	美国	166	94,761.49	0.19

	nal							
201	Chubb Corp	丘博集团	CB UN	纽约交易所	美国	110	94,744.22	0.19
202	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL UN	纽约交易所	美国	219	94,740.20	0.19
203	Equifax Inc	Equifax 公司	EFX UN	纽约交易所	美国	131	94,738.18	0.19
204	Intl Business Machines Corp	国际商业机器	IBM UN	纽约交易所	美国	106	94,726.82	0.19
205	Nielsen Holdings NV	尼尔森控股公 开有限公司	NLSN UN	纽约交易所	美国	313	94,714.35	0.19
206	Salesforce .com	Salesforce.c om 股份有 限公司	CRM UN	纽约交易所	美国	186	94,692.27	0.19
207	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN UN	纽约交易所	美国	396	94,681.36	0.19
208	General Electric Co	通用电气	GE UN	纽约交易所	美国	468	94,665.00	0.19
209	Automatic Data Processing	ADP 公司	ADP UQ	纳斯达 克交易 所	美国	172	94,623.70	0.19
210	Coca-Cola Co	可口可乐	KO UN	纽约交易所	美国	339	94,569.15	0.19
211	Phillips 66	Phillips 66	PSX UN	纽约交易所	美国	178	94,549.41	0.19
212	Travelers Cos Inc	St Paul Travelers	TRV UN	纽约交易所	美国	129	94,539.93	0.19
213	Altria Group Inc	高特利	MO UN	纽约交易所	美国	250	94,498.11	0.19
214	Moody's Corp	穆迪	MCO UN	纽约交易所	美国	145	94,477.33	0.19
215	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH UN	纽约交易所	美国	150	94,462.40	0.19
216	Ball Corp	波尔	BLL UN	纽约交易所	美国	200	94,455.91	0.19
217	ConAgra Foods Inc	康尼格拉食品	CAG UN	纽约交易所	美国	345	94,450.71	0.19

218	Dentsply Intl	登士柏国际集团	XRAY UQ	纳斯达克交易所	美国	239	94,437.40	0.19
219	Citigroup Inc	花旗集团	C UN	纽约交易所	美国	281	94,428.31	0.19
220	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	纽约交易所	美国	114	94,414.09	0.19
221	Northrop Grumman Corp	诺斯洛普格鲁曼	NOC UN	纽约交易所	美国	77	94,406.36	0.19
222	Goodyear Tire & Rubber Co	固特异轮胎橡胶	GT UQ	纳斯达克交易所	美国	445	94,404.93	0.19
223	Sherwin- Williams Co	宣威威廉斯	SHW UN	纽约交易所	美国	56	94,401.36	0.19
224	Nvidia Corp	NVIDIA 公司	NVDA UQ	纳斯达克交易所	美国	441	94,386.81	0.19
225	Regions Financial Corp	Regions 金融	RF UN	纽约交易所	美国	1,514	94,380.58	0.19
226	Allstate Corp	全州保险	ALL UN	纽约交易所	美国	234	94,345.90	0.19
227	Akamai Technologi es Inc	阿卡迈技术公司	AKAM UQ	纳斯达克交易所	美国	276	94,325.25	0.19
228	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW UN	纽约交易所	美国	191	94,310.71	0.19
229	E*TRADE Financial Corp	亿创证券有限公司	ETFC UQ	纳斯达克交易所	美国	490	94,310.45	0.19
230	Airgas Inc	Airgas 股份有限公司	ARG UN	纽约交易所	美国	105	94,310.45	0.19
231	Crown Castle Intl Corp	冠城国际公司	CCI UN	纽约交易所	美国	168	94,310.45	0.19
232	Bristol- Myers Squibb	百时美施贵宝	BMJ UN	纽约交易所	美国	211	94,252.59	0.19
233	SanDisk Corp	闪迪公司	SNDK UQ	纳斯达克交易所	美国	191	94,248.69	0.19

234	Verizon Communications Inc	Verizon 通信 股份有限公司	VZ UN	纽约交 易所	美国	314	94,242.14	0.19
235	LyondellBasell Industries N.V.	利安德巴塞尔 工业公司	LYB UN	纽约交 易所	美国	167	94,237.07	0.19
236	Express Scripts Holding Co.	快捷药方	ESRX UQ	纳斯达 克交易 所	美国	166	94,222.53	0.19
237	Nucor Corp	纽柯公司	NUE UN	纽约交 易所	美国	360	94,209.15	0.19
238	Whole Foods Market Inc	全食超市	WFM UQ	纳斯达 克交易 所	美国	433	94,192.91	0.19
239	United Continental Holding Inc	联合大陆控股 公司	UAL UN	纽约交 易所	美国	253	94,137.07	0.19
240	Keurig Green Mountain Inc	KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	GMC R UQ	纳斯达 克交易 所	美国	161	94,071.35	0.19
241	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX UN	纽约交 易所	美国	94	94,056.29	0.19
242	Intuit Inc	Intuit 公司	INTU UQ	纳斯达 克交易 所	美国	150	93,994.86	0.19
243	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金 融公司	AMP UN	纽约交 易所	美国	136	93,982.65	0.19
244	Robert Half Intl Inc	Robert Half 国际	RHI UN	纽约交 易所	美国	307	93,975.25	0.19
245	CenturyLink Inc	世纪电信公司	CTL UN	纽约交 易所	美国	575	93,942.91	0.19
246	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP UN	纽约交 易所	美国	185	93,942.91	0.19
247	Molson Coors Brewing Co	莫尔森-康胜	TAP UN	纽约交 易所	美国	154	93,921.35	0.19

	B							
248	CSX Corp	CSX 公司	CSX UN	纽约交易所	美国	557	93,859.47	0.19
249	Tenet Healthcare	Tenet 保健	THC UN	纽约交易所	美国	477	93,852.65	0.19
250	Advance Auto Parts Inc	领先汽车配件公司	AAP UN	纽约交易所	美国	96	93,825.77	0.19
251	Micron Technology Inc	美光技术	MU UQ	纳斯达克交易所	美国	1,020	93,788.36	0.19
252	T Rowe Price Group Inc	T Rowe Price	TROW UQ	纳斯达克交易所	美国	202	93,773.95	0.19
253	Allegion plc	Allegion 公共有限公司	ALLE UN	纽约交易所	美国	219	93,744.73	0.19
254	J.M. Smucker Co	JM 斯马克公司	SJM UN	纽约交易所	美国	117	93,707.71	0.19
255	Ingersoll-Rand Plc	英格索兰	IR UN	纽约交易所	美国	261	93,707.13	0.19
256	Coca-Cola Enterprises	可口可乐企业	CCE UN	纽约交易所	美国	293	93,685.25	0.19
257	Visa Inc	维萨公司	V UN	纽约交易所	美国	186	93,665.63	0.19
258	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX UN	纽约交易所	美国	782	93,638.23	0.19
259	Merck & Co Inc	默克	MRK UN	纽约交易所	美国	273	93,636.80	0.19
260	Xylem Inc	Xylem 公司/纽约	XYL UN	纽约交易所	美国	395	93,621.48	0.19
261	Home Depot Inc	家得宝	HD UN	纽约交易所	美国	109	93,606.87	0.19
262	McDonalds Corp	麦当劳	MCD UN	纽约交易所	美国	122	93,592.78	0.19
263	Leggett & Platt	礼恩派	LEG UN	纽约交易所	美国	343	93,591.35	0.19
264	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU UN	纽约交易所	美国	177	93,569.98	0.19
265	Textron Inc	德事隆	TXT UN	纽约交易所	美国	343	93,569.07	0.19
266	National	美国国民油井	NOV UN	纽约交	美国	430	93,512.39	0.19

	Oilwell Varco Inc			易所				
267	Snap On Inc	Snap-On 公司	SNA UN	纽约交 易所	美国	84	93,508.62	0.19
268	Intel Corp	英特尔公司	INTC UQ	纳斯达 克交易 所	美国	418	93,508.49	0.19
269	American Airlines Group Inc.	美国航空集团 公司	AAL UQ	纳斯达 克交易 所	美国	340	93,501.35	0.19
270	Borgwarner Inc	博格华纳股份 有限公司	BWA UN	纽约交 易所	美国	333	93,479.20	0.19
271	Whirlpool Corp	惠而浦	WHR UN	纽约交 易所	美国	98	93,464.07	0.19
272	Oracle Corp	甲骨文	ORCL UN	纽约交 易所	美国	394	93,461.22	0.19
273	Kroger Co	克罗格公司	KR UN	纽约交 易所	美国	344	93,439.79	0.19
274	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP UN	纽约交 易所	美国	144	93,433.03	0.19
275	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG UN	纽约交 易所	美国	327	93,408.68	0.19
276	Precision Castparts Corp	Precision Castparts 公 司	PCP UN	纽约交 易所	美国	62	93,407.97	0.19
277	Medtronic Inc	美敦力	MDT UN	纽约交 易所	美国	187	93,404.20	0.19
278	Sempra Energy	桑普拉能源	SRE UN	纽约交 易所	美国	153	93,400.89	0.19
279	Johnson & Johnson	强生	JNJ UN	纽约交 易所	美国	140	93,383.16	0.19
280	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST UQ	纳斯达 克交易 所	美国	89	93,335.76	0.19
281	Zimmer Biomet Holdings In	捷迈巴奥米特 控股公司	ZBH UN	纽约交 易所	美国	140	93,264.98	0.19
282	FMC Corp	FMC 公司	FMC UN	纽约交 易所	美国	367	93,252.71	0.19
283	Urban Outfitters	Urban Outfitters 公司	URBN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	631	93,217.25	0.19

284	Tyson Foods Inc A	泰森食品公司	TSN UN	纽约交易所	美国	269	93,155.69	0.19
285	L-3 Communications Holdings	L-3 通讯控股	LLL UN	纽约交易所	美国	120	93,126.02	0.19
286	Dominion Resources Inc	多米诺资源	D UN	纽约交易所	美国	212	93,116.15	0.19
287	State Street Corp	道富集团	STT UN	纽约交易所	美国	216	93,077.70	0.19
288	Clorox Co	Clorox 公司	CLX UN	纽约交易所	美国	113	93,064.91	0.19
289	Exelon Corp	Exelon 公司	EXC UN	纽约交易所	美国	516	93,048.87	0.19
290	Lincoln National Corp	林肯国民	LNC UN	纽约交易所	美国	285	93,014.98	0.19
291	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF UQ	纳斯达克交易所	美国	242	92,982.77	0.19
292	Enesco PLC - CL A	恩斯克国际公司	ESV UN	纽约交易所	美国	930	92,940.95	0.19
293	Danaher Corp	丹纳赫	DHR UN	纽约交易所	美国	154	92,881.34	0.19
294	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢	SLB UN	纽约交易所	美国	205	92,850.36	0.19
295	Cintas Corp	CINTAS 公司	CTAS UQ	纳斯达克交易所	美国	157	92,825.04	0.19
296	Dollar Tree Inc	Dollar Tree 公司	DLTR UQ	纳斯达克交易所	美国	185	92,765.62	0.19
297	Lennar Corp	Lennar 公司	LEN UN	纽约交易所	美国	292	92,739.78	0.19
298	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO UQ	纳斯达克交易所	美国	167	92,718.87	0.19
299	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具	ITW UN	纽约交易所	美国	154	92,681.33	0.19
300	Plum Creek	Plum Creek	PCL UN	纽约交	美国	299	92,652.50	0.19

	Timber Co	林业		易所				
301	Ryder System Inc	Ryder 系统	R UN	纽约交易所	美国	251	92,626.85	0.19
302	Amphenol Corp A	安费诺公司	APH UN	纽约交易所	美国	273	92,590.88	0.19
303	Autodesk Inc	欧特克	ADSK UQ	纳斯达克交易所	美国	234	92,583.28	0.19
304	United Parcel Service Inc B	联合包裹服务股份有限公司	UPS UN	纽约交易所	美国	148	92,482.11	0.19
305	SL Green Realty Corp	SL Green 房地产公司	SLG UN	纽约交易所	美国	126	92,439.51	0.19
306	Unitedhealth Group Inc	联合健康	UNH UN	纽约交易所	美国	121	92,432.76	0.19
307	CBS Corp B	哥伦比亚广播公司	CBS UN	纽约交易所	美国	302	92,425.10	0.19
308	Torchmark Corp	Torchmark 公司	TMK UN	纽约交易所	美国	249	92,422.37	0.19
309	FLIR Systems Inc	FLIR 系统公司	FLIR UQ	纳斯达克交易所	美国	507	92,413.60	0.19
310	Avago Technologies Ltd	安华高科技有限公司	AVGO UQ	纳斯达克交易所	美国	98	92,369.51	0.19
311	Broadcom Corp A	Broadcom 公司	BRCM UQ	纳斯达克交易所	美国	246	92,363.15	0.19
312	Citrix Systems Inc	思杰系统	CTXS UQ	纳斯达克交易所	美国	188	92,353.28	0.19
313	Stryker Corp	史赛克	SYK UN	纽约交易所	美国	153	92,337.82	0.19
314	Unum Group	尤那姆集团	UNM UN	纽约交易所	美国	427	92,305.42	0.19
315	Accenture plc	埃森哲公司	ACN UN	纽约交易所	美国	136	92,287.04	0.19
316	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV UN	纽约交易所	美国	330	92,272.76	0.19
317	Ross	Ross 商店有	ROST UQ	纳斯达	美国	264	92,247.04	0.19

	Stores Inc	限公司		克交易所				
318	CF Industries Holdings	CF 工业控股股份有限公司	CF UN	纽约交易所	美国	348	92,221.33	0.19
319	ConocoPhillips	康菲石油	COP UN	纽约交易所	美国	304	92,168.60	0.19
320	TEGNA Inc	TEGNA 股份有限公司	TGNA UN	纽约交易所	美国	556	92,138.47	0.19
321	Xilinx Inc	赛灵思	XLNX UQ	纳斯达克交易所	美国	302	92,111.33	0.19
322	Michael Kors Holdings Ltd	迈克高仕控股有限公司	KORS UN	纽约交易所	美国	354	92,087.30	0.19
323	Flowserve Corp	福斯公司	FLS UN	纽约交易所	美国	337	92,085.48	0.19
324	Cummins Inc	康明斯	CMI UN	纽约交易所	美国	161	92,011.78	0.19
325	Legg Mason Inc	美盛集团	LM UN	纽约交易所	美国	361	91,962.56	0.19
326	Public Service Enterprise Grp	公共服务企业集团	PEG UN	纽约交易所	美国	366	91,952.88	0.19
327	Monster Beverage Corp	Monster 饮料公司	MNST UQ	纳斯达克交易所	美国	95	91,892.23	0.19
328	Fossil Group Inc	化石集团	FOSL UQ	纳斯达克交易所	美国	387	91,876.13	0.19
329	The ADT Corp.	ADT 公司	ADT UN	纽约交易所	美国	429	91,874.18	0.19
330	General Dynamics	通用动力	GD UN	纽约交易所	美国	103	91,871.97	0.19
331	Edwards Lifesciences Corp	Edwards Lifesciences 公司	EW UN	纽约交易所	美国	179	91,802.75	0.19
332	Hanesbrands Inc	汉佰有限公司	HBI UN	纽约交易所	美国	480	91,731.19	0.19
333	NIKE Inc B	耐克公司	NKE UN	纽约交易所	美国	226	91,722.10	0.19
334	Alexion	Alexion 制药	ALXN UQ	纳斯达克	美国	74	91,660.41	0.19

	Pharmaceuticals Inc	公司		克交易所				
335	Lockheed Martin	洛克希德马丁	LMT UN	纽约交易所	美国	65	91,655.54	0.19
336	Staples Inc	史泰博公司	SPLS UQ	纳斯达克交易所	美国	1,490	91,626.64	0.19
337	Time Warner Cable Inc	时代华纳有线公司	TWC UN	纽约交易所	美国	76	91,591.19	0.19
338	Humana Inc	Humana 公司	HUM UN	纽约交易所	美国	79	91,574.63	0.19
339	Wal-Mart Stores	沃尔玛百货	WMT UN	纽约交易所	美国	230	91,553.27	0.19
340	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY UN	纽约交易所	美国	225	91,550.02	0.19
341	Johnson Controls Inc	江森自控	JCI UN	纽约交易所	美国	357	91,546.32	0.19
342	PG&E Corporation	太平洋煤气电力	PCG UN	纽约交易所	美国	265	91,529.56	0.19
343	Cameron International Corp	卡梅隆国际公司	CAM UN	纽约交易所	美国	223	91,518.20	0.19
344	Stanley Black & Decker	史丹利百得公司	SWK UN	纽约交易所	美国	132	91,484.17	0.19
345	Fiserv Inc	Fiserv 公司	FISV UQ	纳斯达克交易所	美国	154	91,461.32	0.19
346	General Motors Co	通用汽车公司	GM UN	纽约交易所	美国	414	91,430.80	0.19
347	Raytheon Co	雷神公司	RTN UN	纽约交易所	美国	113	91,377.22	0.19
348	Pepco Holdings Inc	Pepco 控股股份有限公司	POM UN	纽约交易所	美国	541	91,374.11	0.19
349	Newfield Exploration Co	新田石油勘探公司	NFX UN	纽约交易所	美国	432	91,338.46	0.19
350	Tyco Intl	泰科国际	TYC UN	纽约交易所	美国	441	91,322.68	0.19

351	Freeport McMoRan Copper & Gold	自由港迈克默 伦股份有限公 司	FCX UN	纽约交 易所	美国	2,07 7	91,308.39	0.19
352	Navient Corp	Navient 公司	NAVI UQ	纳斯达 克交易 所	美国	1,22 8	91,303.91	0.19
353	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY UN	纽约交 易所	美国	1,06 6	91,303.52	0.19
354	Goldman Sachs Group Inc	高盛	GS UN	纽约交 易所	美国	78	91,286.64	0.19
355	Air Products & Chemicals Inc	空气化工产品	APD UN	纽约交 易所	美国	108	91,247.29	0.18
356	Campbell Soup Co	金宝汤	CPB UN	纽约交 易所	美国	267	91,110.73	0.18
357	Dun & Bradstreet Corp	邓白氏公司	DNB UN	纽约交 易所	美国	135	91,108.78	0.18
358	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS UN	纽约交 易所	美国	441	91,093.58	0.18
359	Boeing Co	波音	BA UN	纽约交 易所	美国	97	91,074.23	0.18
360	Bard C.R. Inc	CR 巴德	BCR UN	纽约交 易所	美国	74	91,030.92	0.18
361	Comerica Inc (MI)	Comerica 公 司	CMA UN	纽约交 易所	美国	335	90,995.14	0.18
362	Hunt J.B. Transport Services	JB 亨特运输服 务公司	JBHT UQ	纳斯达 克交易 所	美国	191	90,986.76	0.18
363	Brown- Forman Corp B	布朗福曼	BF/B UN	纽约交 易所	美国	141	90,900.53	0.18
364	Limited Brands Inc	L Brands 股份 有限公司	LB UN	纽约交 易所	美国	146	90,843.65	0.18
365	VeriSign Inc	威瑞信公司	VRSN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	160	90,764.94	0.18
366	Texas Instrument s Inc	德州仪器	TXN UQ	纳斯达 克交易 所	美国	255	90,758.13	0.18
367	BAXALTA	Baxalta 股份	BXLT UN	纽约交	美国	358	90,733.38	0.18

	INC	有限公司		易所				
368	Cerner Corp	塞纳公司	CERN UQ	纳斯达克交易所	美国	232	90,647.02	0.18
369	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UQ	纳斯达克交易所	美国	279	90,558.58	0.18
370	Under Armour Inc Class A	安德玛公司	UA UN	纽约交易所	美国	173	90,556.69	0.18
371	Comcast Corp	康卡斯特	CMCSA UQ	纳斯达克交易所	美国	247	90,509.16	0.18
372	The Williams Companies Inc	威廉姆斯公司	WMB UN	纽约交易所	美国	542	90,451.95	0.18
373	Aon plc	怡安保险	AON UN	纽约交易所	美国	151	90,415.00	0.18
374	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	Verisk 分析公司	VRSK UQ	纳斯达克交易所	美国	181	90,360.26	0.18
375	Corning Inc	康宁公司	GLW UN	纽约交易所	美国	761	90,332.99	0.18
376	Hartford Finl Services Group	哈特福德金融服务	HIG UN	纽约交易所	美国	320	90,307.79	0.18
377	Eastman Chemical Co	伊士曼化工	EMN UN	纽约交易所	美国	206	90,306.88	0.18
378	eBay Inc.	电子湾	EBAY UQ	纳斯达克交易所	美国	506	90,292.73	0.18
379	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假酒店公司	HST UN	纽约交易所	美国	906	90,248.31	0.18
380	Hewlett-Packard Co	惠普	HPQ UN	纽约交易所	美国	1,173	90,185.19	0.18
381	Tiffany & Co	蒂芙尼	TIF UN	纽约交易所	美国	182	90,162.21	0.18
382	Walgreens	Walgreens	WBA UQ	纳斯达克	美国	163	90,132.92	0.18

	Boots Alliance	Boots Alliance 公司		克交易所				
383	Walt Disney Co	沃尔特迪斯尼	DIS UN	纽约交易所	美国	132	90,069.87	0.18
384	Zions Bancorp (UT)	Zions 银行	ZION UQ	纳斯达克交易所	美国	508	90,055.84	0.18
385	American Tower Corp A	美国发射塔公司	AMT UN	纽约交易所	美国	143	90,026.30	0.18
386	Assurant Inc	艾斯兰公司	AIZ UN	纽约交易所	美国	172	89,955.06	0.18
387	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	APC UN	纽约交易所	美国	285	89,905.84	0.18
388	Masco Corp	马斯可	MAS UN	纽约交易所	美国	489	89,862.98	0.18
389	Delta Air Lines	达美航空有限公司	DAL UN	纽约交易所	美国	273	89,860.84	0.18
390	Mohawk Industries Inc	Mohawk 工业股份有限公司	MHK UN	纽约交易所	美国	73	89,777.07	0.18
391	Marriott Intl A	万豪国际	MAR UQ	纳斯达克交易所	美国	206	89,678.17	0.18
392	Darden Restaurants Inc	达登饭店	DRI UN	纽约交易所	美国	217	89,675.84	0.18
393	Kellogg Co	家乐氏	K UN	纽约交易所	美国	191	89,634.86	0.18
394	Juniper Networks Inc	Juniper 公司	JNPR UN	纽约交易所	美国	500	89,611.68	0.18
395	Baker Hughes Inc	贝克休斯	BHI UN	纽约交易所	美国	299	89,604.21	0.18
396	Dow Chemical	陶氏化学	DOW UN	纽约交易所	美国	268	89,589.86	0.18
397	CVS Caremark Corp.	CVS 保健公司	CVS UN	纽约交易所	美国	141	89,517.98	0.18
398	AutoNation Inc	AutoNation 公司	AN UN	纽约交易所	美国	231	89,491.29	0.18
399	Chicago Mercantile	芝加哥商业交易所控股公司	CME UQ	纳斯达克交易所	美国	152	89,424.66	0.18

	Exchange			所				
400	American Express Co	美国运通	AXP UN	纽约交易所	美国	198	89,422.72	0.18
401	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC UN	纽约交易所	美国	145	89,421.09	0.18
402	Yahoo Inc	雅虎	YHOO UQ	纳斯达克交易所	美国	414	89,414.53	0.18
403	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW UQ	纳斯达克交易所	美国	222	89,406.74	0.18
404	Newell Rubbermaid Inc	纽威尔	NWL UN	纽约交易所	美国	312	89,306.22	0.18
405	Cognizant Tech Solutions Corp	高知特科技公司	CTSH UQ	纳斯达克交易所	美国	229	89,251.80	0.18
406	Mead Johnson Nutrition Co	美赞臣营养品公司	MJN UN	纽约交易所	美国	174	89,204.53	0.18
407	NetFlix Inc	奈飞公司	NFLX UQ	纳斯达克交易所	美国	120	89,128.56	0.18
408	Occidental Petroleum	西方石油	OXY UN	纽约交易所	美国	203	89,123.56	0.18
409	Target Corp	塔吉特公司	TGT UN	纽约交易所	美国	189	89,113.56	0.18
410	3M Co	3M 公司	MMM UN	纽约交易所	美国	91	89,015.83	0.18
411	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM UN	纽约交易所	美国	507	88,923.81	0.18
412	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC UQ	纳斯达克交易所	美国	228	88,906.48	0.18
413	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN UN	纽约交易所	美国	427	88,728.55	0.18
414	CarMax Inc	CarMax 股份有限公司	KMX UN	纽约交易所	美国	253	88,666.28	0.18

415	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK UN	纽约交易所	美国	133	88,619.00	0.18
416	Teradata Corp	美商天睿信息系统有限公司	TDC UN	纽约交易所	美国	516	88,525.43	0.18
417	PVH Corp	PVH 公司	PVH UN	纽约交易所	美国	185	88,476.92	0.18
418	Macys Inc	梅西百货	M UN	纽约交易所	美国	389	88,359.84	0.18
419	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD UQ	纳斯达克交易所	美国	134	88,049.71	0.18
420	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC UN	纽约交易所	美国	160	87,886.98	0.18
421	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	美国	300	87,858.41	0.18
422	Anthem Inc	Anthem 股份有限公司	ANTM UN	纽约交易所	美国	97	87,830.36	0.18
423	DaVita HealthCare Partners Inc	DaVita 保健合伙公司	DVA UN	纽约交易所	美国	194	87,817.76	0.18
424	E. I. du Pont de Nemours and Company	杜邦	DD UN	纽约交易所	美国	203	87,792.17	0.18
425	Starwood Hotel & Resort World Inc	喜达屋饭店	HOT UN	纽约交易所	美国	195	87,725.94	0.18
426	Principal Financial Group	信安金融	PFG UN	纽约交易所	美国	300	87,624.64	0.18
427	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿业	NEM UN	纽约交易所	美国	749	87,498.08	0.18
428	AGL Resources	AGL 资源公司	GAS UN	纽约交易所	美国	210	87,014.89	0.18
429	VF Corp	VF 公司	VFC UN	纽约交易所	美国	215	86,908.72	0.18
430	Viacom Inc	维亚康姆公司	VIAB UQ	纳斯达克	美国	325	86,864.89	0.18

	B			克交易所				
431	Grainger W.W. Inc	WW Grainger 公司	GWW UN	纽约交易所	美国	66	86,825.54	0.18
432	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO UN	纽约交易所	美国	18	86,718.00	0.18
433	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG UN	纽约交易所	美国	135	86,629.17	0.18
434	McGraw- Hill Financial Inc	麦格希	MHFI UN	纽约交易所	美国	135	86,418.78	0.18
435	Owens- Illinois Inc	Owens- Illinois 股 份有限公司	OI UN	纽约交易所	美国	763	86,309.42	0.17
436	Hess Corp	阿美拉达赫斯	HES UN	纽约交易所	美国	274	86,257.87	0.17
437	Fidelity National Informatio n	富达国民信息 服务公司	FIS UN	纽约交易所	美国	219	86,179.16	0.17
438	Time Warner Inc	时代华纳	TWX UN	纽约交易所	美国	205	86,087.93	0.17
439	Total System Services Inc	全系统服务公 司	TSS UN	纽约交易所	美国	266	86,019.42	0.17
440	Dover Corp	多佛	DOV UN	纽约交易所	美国	216	85,994.49	0.17
441	GameStop Corp A	GameStop 公司	GME UN	纽约交易所	美国	472	85,942.02	0.17
442	Wyndham Worldwide Corp	Wyndham 公司	WYN UN	纽约交易所	美国	182	85,860.33	0.17
443	Universal Health Services	Universal Health Services 公	UHS UN	纽约交易所	美国	110	85,351.23	0.17
444	Praxair Inc	普莱克斯	PX UN	纽约交易所	美国	128	85,112.91	0.17
445	General Mills Inc	通用磨坊	GIS UN	纽约交易所	美国	227	84,993.56	0.17
446	Halliburto n Co	哈利伯顿	HAL UN	纽约交易所	美国	384	84,880.18	0.17

447	Apple Inc.	苹果公司	AAPL UQ	纳斯达克交易所	美国	124	84,756.03	0.17
448	Intl Paper Co	国际纸业	IP UN	纽约交易所	美国	345	84,459.01	0.17
449	COLUMBIA PIPELINE GROUP	哥伦比亚管道集团股份有限公司	CPGX UN	纽约交易所	美国	650	84,416.80	0.17
450	Capital One Financial	第一资本金融	COF UN	纽约交易所	美国	180	84,367.45	0.17
451	Deere & Co	迪尔	DE UN	纽约交易所	美国	170	84,195.37	0.17
452	Diamond Offshore Drilling	钻石近海钻探公司	DO UN	纽约交易所	美国	614	84,127.19	0.17
453	Hasbro Inc	孩之宝	HAS UQ	纳斯达克交易所	美国	192	83,982.51	0.17
454	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI UN	纽约交易所	美国	860	83,320.68	0.17
455	FedEx Corp	联邦快递	FDX UN	纽约交易所	美国	86	83,203.41	0.17
456	Pioneer Natural Resources	Pioneer 自然资源公司	PXD UN	纽约交易所	美国	102	83,045.09	0.17
457	Electronic Arts	电子艺界	EA UQ	纳斯达克交易所	美国	186	83,000.68	0.17
458	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS UQ	纳斯达克交易所	美国	166	82,817.95	0.17
459	St Jude Medical Inc	圣犹达医疗用品	STJ UN	纽约交易所	美国	206	82,628.59	0.17
460	Cimarex Energy Co	Cimarex 能源公司	XEC UN	纽约交易所	美国	142	82,416.51	0.17
461	Stericycle Inc	Stericycle 公司	SRCL UQ	纳斯达克交易所	美国	105	82,228.46	0.17
462	Pentair Ltd.	Pentair 公共有限公司	PNR UN	纽约交易所	美国	254	81,693.51	0.17
463	AES Corp	爱伊斯	AES UN	纽约交易所	美国	1,310	81,408.32	0.16

464	Pulte Group Inc	Pulte 集团公司	PHM UN	纽约交易所	美国	703	81,348.31	0.16
465	Affiliated Managers Group	联合经理集团股份有限公司	AMG UN	纽约交易所	美国	78	80,918.57	0.16
466	EOG Resources	EOG 资源	EOG UN	纽约交易所	美国	176	80,904.02	0.16
467	NetApp Inc	网域存储技术	NTAP UQ	纳斯达克交易所	美国	467	80,452.52	0.16
468	Signet Jewelers Ltd	英国西格尼珠宝有限公司	SIG UN	纽约交易所	美国	100	80,319.34	0.16
469	Best Buy Co Inc	百思买	BBY UN	纽约交易所	美国	402	79,487.51	0.16
470	PACCAR Inc	帕卡	PCAR UQ	纳斯达克交易所	美国	258	79,411.53	0.16
471	Qorvo, Inc	Qorvo 股份有限公司	QRVO UQ	纳斯达克交易所	美国	240	79,325.82	0.16
472	Transocean Inc	Transocean 公司	RIG UN	纽约交易所	美国	984	79,104.52	0.16
473	Caterpillar Inc	卡特彼勒	CAT UN	纽约交易所	美国	179	78,993.61	0.16
474	Synchrony Financial	Synchrony 金融	SYF UN	纽约交易所	美国	400	78,988.15	0.16
475	Murphy Oil Corp	墨菲石油公司	MUR UN	纽约交易所	美国	537	78,284.57	0.16
476	F5 Networks Inc	F5 Networks 公司	FFIV UQ	纳斯达克交易所	美国	124	78,072.81	0.16
477	Marathon Oil Corp	马拉松石油	MRO UN	纽约交易所	美国	954	77,993.72	0.16
478	Endo International	Endo 制药控股有限公司	ENDP UQ	纳斯达克交易所	美国	196	77,917.49	0.16
479	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR UN	纽约交易所	美国	588	77,319.30	0.16
480	Harley-Davidson Inc	哈雷摩托车	HOG UN	纽约交易所	美国	262	77,223.06	0.16
481	Kansas	Kansas City	KSU UN	纽约交	美国	159	77,095.46	0.16

	City Southern Inc	Southern		易所				
482	Perrigo Co	Perrigo 公司	PRGO UN	纽约交易所	美国	82	77,049.16	0.16
483	FMC Technologies Inc	FMC 技术公司	FTI UN	纽约交易所	美国	409	77,047.15	0.16
484	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM UN	纽约交易所	美国	323	76,933.84	0.16
485	HCA Holdings Inc	HCA 控股公司	HCA UN	纽约交易所	美国	174	76,414.22	0.15
486	Priceline.com Inc	Priceline 集团	PCLN UQ	纳斯达克交易所	美国	9	74,511.14	0.15
487	Leucadia National Corp (NY)	Leucadia National 公司	LUK UN	纽约交易所	美国	653	73,739.18	0.15
488	Martin Marietta	Martin Marietta 材料股份有限	MLM UN	纽约交易所	美国	83	73,612.36	0.15
489	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK UN	纽约交易所	美国	248	73,467.03	0.15
490	News Corporation	美国新闻集团	NWSA UQ	纳斯达克交易所	美国	834	72,353.25	0.15
491	Bed Bath & Beyond Inc	Bed Bath & Beyond	BBBY UQ	纳斯达克交易所	美国	225	70,496.15	0.14
492	Mosaic Co	Mosaic 公司	MOS UN	纽约交易所	美国	392	70,230.10	0.14
493	Seagate Technology	希捷科技公司	STX UQ	纳斯达克交易所	美国	295	70,226.34	0.14
494	21st Century Fox	新闻集团	FOXA UQ	纳斯达克交易所	美国	378	66,666.41	0.14
495	Gap Inc	Gap 公司	GPS UN	纽约交易所	美国	412	66,081.47	0.13
496	Nordstrom Inc	Nordstrom 公司	JWN UN	纽约交易所	美国	195	63,072.01	0.13
497	Chipotle	Chipotle	CMG UN	纽约交	美国	20	62,319.08	0.13

	Mexican Grill Inc.	Mexican Grill 股份		易所				
498	Discovery CommunicationsC	探索传播公司	DISCK UQ	纳斯达克交易所	美国	365	59,775.54	0.12
499	Alphabet Inc A	Alphabet 公司	GOOGL UQ	纳斯达克交易所	美国	9	45,468.77	0.09
500	Alphabet Inc C	Alphabet 公司	GOOG UQ	纳斯达克交易所	美国	9	44,350.77	0.09
501	Discovery CommunicationsA	探索传播公司	DISCA UQ	纳斯达克交易所	美国	212	36,728.84	0.07
502	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	新闻集团	FOX UQ	纳斯达克交易所	美国	124	21,925.77	0.04
503	News Corp B	美国新闻集团	NWS UQ	纳斯达克交易所	美国	207	18,764.69	0.04

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	Endo International plc	ENDP UQ	195,526.13	0.18
2	American Airlines Group Inc.	AAL UQ	192,291.85	0.18
3	Hanesbrands Inc	HBI UN	173,689.93	0.16
4	Schein Henry 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	132,233.93	0.12
11	Southwestern Energy Co	SWN UN	129,869.78	0.12

12	Advance Auto Parts Inc	AAP UN	120,913.24	0.11
13	CONSOL Energy Inc	CNX UN	113,317.94	0.11
14	Hunt J.B. Transport Services	JBHT UQ	112,361.60	0.10
15	Activision Blizzard Inc	ATVI UQ	104,436.93	0.10
16	Chesapeake Energy Corp	CHK UN	102,633.46	0.10
17	United Continental Holding Inc	UAL UN	99,537.37	0.09
18	Illumina Inc	ILMN UQ	94,095.78	0.09
19	Freeport-McMoRan Inc	FCX UN	93,492.18	0.09
20	Verisk Analytics Inc	VRSK UQ	92,718.21	0.09

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	Hospira Inc	HSP UN	286,435.62	0.27
2	NetFlx Inc	NFLX UQ	274,689.55	0.26
3	Altera Corp	ALTR UQ	263,659.07	0.25
4	Nabors Industries Ltd	NBR UN	262,887.05	0.25
5	Pall Corp	PLL UN	260,115.26	0.24
6	Medtronic plc	MDT UN	245,054.53	0.23
7	Denbury Resources Inc	DNR UN	240,992.80	0.22
8	Sigma-Aldrich Corp	SIAL UQ	207,665.02	0.19
9	PETSMART Inc	PETM UQ	206,102.70	0.19
10	Safeway Inc	SWY UN	206,008.44	0.19
11	Cablevision Systems Co A	CVC UN	204,696.32	0.19
12	Windstream Holdings Inc	WIN UQ	201,588.41	0.19
13	QEP Resources	QEP UN	200,465.20	0.19
14	Electronic Arts	EA UQ	199,366.99	0.19
15	Vulcan Materials Co	VMC UN	198,547.75	0.19
16	Reynolds American Inc	RAI UN	197,906.72	0.18
17	Noble Corp plc	NE UN	197,848.22	0.18
18	Boston Scientific Corp	BSX UN	195,656.62	0.18
19	Total System Services Inc	TSS UN	194,613.33	0.18
20	Newfield Exploration Co	NFX UN	193,869.04	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	7,492,186.59
卖出收入（成交）总额	61,693,720.34

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	-
3	应收股利	63,306.30
4	应收利息	103.07
5	应收申购款	75,726.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,136.17

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
3,011	11,382.28	31,352.67	0.09%	34,240,682.66	99.91%

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	111,953.81	0.3266%

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的情况

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	75,142,701.26
本报告期基金总申购份额	20,915,768.64

减:本报告期基金总赎回份额	61,786,434.57
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	34,272,035.33

§ 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。

5、基金管理人于 2015 年 10 月 15 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十一次会议审议通过，杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

6、基金管理人分别于 2015 年 10 月 16 日、10 月 30 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十次会议审议通过，周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

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	68,068,664.02	100.00%	19,385.69	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/31
2	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2016 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/28
3	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/22
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	2015/11/24
5	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 2 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/6
6	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 2 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/6
7	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/24
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	2015/8/31
9	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年半年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
10	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/27
11	大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/21
12	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/1

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
15	大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书（2015 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/8
16	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
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	2015/3/31
18	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
19	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
20	大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/14
21	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
22	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
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、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/15
24	大成基金管理有限公司 关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/1/7
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	2015/1/13
26	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
27	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	2015/1/22

		站	
28	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
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售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	2015/1/24
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售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	2015/1/24
31	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
32	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
33	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/2/4
34	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
35	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
36	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/4
37	“大成上上签”活动获奖名单	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
38	大成基金电子直销交易系统维护通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/6
39	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
40	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
41	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

42	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/3/28
43	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
44	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/9
45	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/14
46	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/4/17
47	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
48	大成基金管理有限公司关于增加联讯证券股份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	2015/5/5
49	关于大成基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/7
50	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
51	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售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	2015/5/9
52	大成基金管理有限公司关于参与上海天天基金销售有限公司认购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/5/9
53	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售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	2015/5/12
54	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
55	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
56	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	中国证监会指定报刊及本公司网	2015/5/19

	机构并开通相关业务的公告	站	
57	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/2
58	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/3
59	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/6/8
60	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	2015/6/11
61	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
62	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
63	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
64	大成基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/7
65	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/10
66	大成基金管理有限公司关于养老金账户通过直销中心申购旗下部分基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/27
67	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/7/29
68	关于大成基金管理有限公司上海理财中心办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/13
69	大成基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2015/8/14
70	大成基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/8/22

71	大成基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司代销公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/1
72	大成基金管理有限公司关于增加南京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	2015/9/12
73	大成基金管理有限公司关于增加南京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	2015/9/15
74	大成基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售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	2015/9/17
75	大成基金管理有限公司关于参加好买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	2015/9/25
76	大成基金管理有限公司关于参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/9/25
77	大成基金管理有限公司关于增加上海银行股份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	2015/9/30
78	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	2015/10/15
79	大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/15
80	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	2015/10/16
81	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
82	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/10/21
83	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	2015/10/30
84	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	2015/11/10
85	关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为开放式基金代销机构并开通相关	中国证监会指定报刊及本公司网	2015/11/16

	业务的公告	站	
86	关于上海陆金所资产管理有限公司增加代销大成基金管理有限公司基金产品的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/11/28
87	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/2
88	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/17
89	大成基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份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	2015/12/18
90	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
91	大成基金管理有限公司关于网上直销系统暂停服务的通知	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/29
92	大成基金管理有限公司关于指数熔断机制对公司旗下公募基金相关业务事项影响的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2015/12/31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

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
2016 年 3 月 26 日