

大成标普 500 等权重指数证券投资基金  
2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 25 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（以下简称“中国银行”）根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 23 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5         |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 净值表现 .....                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 8         |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....             | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 9         |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 9         |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 10        |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 11        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 11        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....     | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 12        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 13        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 14        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 15        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>26</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 26        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....              | 27        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....                      | 27        |
| 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 .....         | 27        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                     | 47        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                  | 48        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....      | 48        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....   | 49        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....   | 49        |
| 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 .....     | 49        |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.11 投资组合报告附注 .....                    | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>             | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....            | 49        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....         | 50        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>             | <b>50</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>               | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 50        |
| 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 ..... | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                   | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 50        |
| 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 .....    | 51        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 51        |
| 10.8 其他重大事件 .....                      | 52        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>       | <b>53</b> |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>               | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                      | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                        | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                        | 53        |

## § 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 | 131,452,444.92 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。<br>本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。 |
| 业绩比较基准 | 标普 500 等权重指数（全收益指数）   |
| 风险收益特征 | 本基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                        | 基金托管人                    |
|---------|------|------------------------------|--------------------------|
| 名称      |      | 大成基金管理有限公司                   | 中国银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杜鹏                           | 唐州徽                      |
|         | 联系电话 | 0755-83183388                | 010-66594855             |
|         | 电子邮箱 | dupeng@dcfund.com.cn         | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话  |      | 4008885558                   | 95566                    |
| 传真      |      | 0755-83199588                | 010-66594942             |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号         |

|       |                                 |                     |
|-------|---------------------------------|---------------------|
| 办公地址  | 深圳市福田区深南大道<br>7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1<br>号 |
| 邮政编码  | 518040                          | 100818              |
| 法定代表人 | 张树忠                             | 肖钢                  |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>                   |
| 基金半年度报告备置地点          | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层<br>大成基金管理有限公司<br>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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 604,736.69                            |
| 本期利润          | 9,880,152.83                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0702                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 7.43%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 7.13%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | -7,078,196.92                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0538                               |

|                     |                         |
|---------------------|-------------------------|
| 期末基金资产净值            | 124,374,248.00          |
| 期末基金份额净值            | 0.946                   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2012年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | -5.40%                  |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

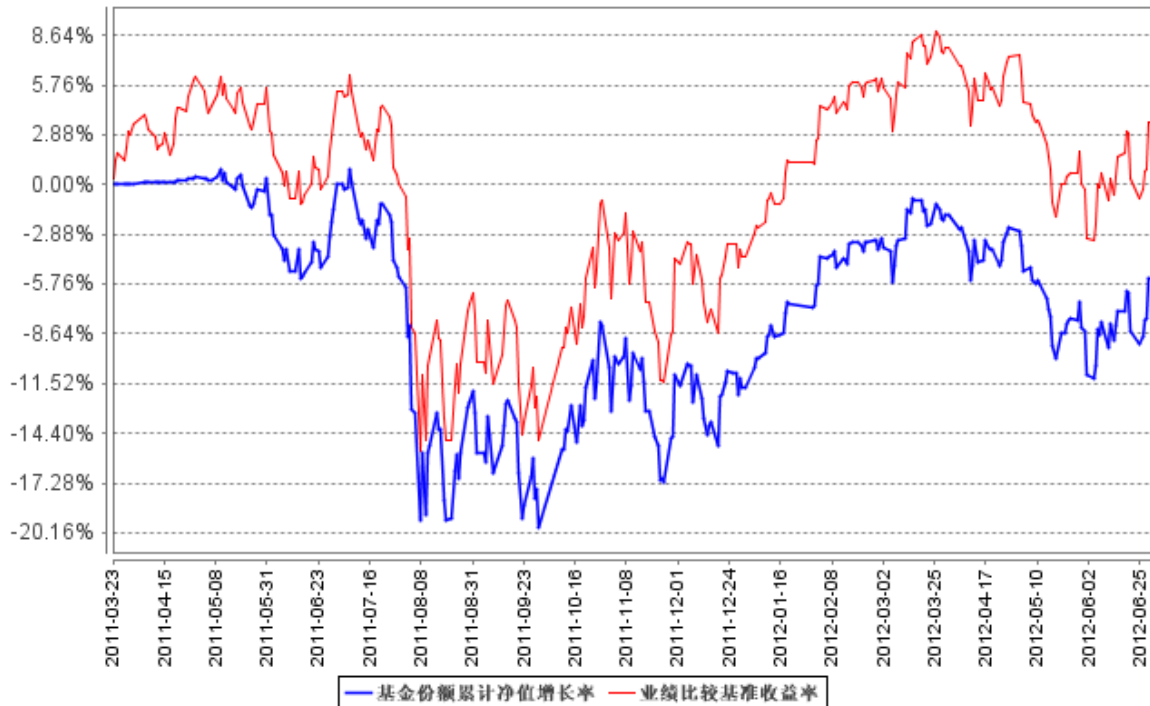
## 3.2 净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 3.39%    | 1.35%       | 3.89%      | 1.46%         | -0.50% | -0.11% |
| 过去三个月      | -3.67%   | 1.03%       | -4.04%     | 1.14%         | 0.37%  | -0.11% |
| 过去六个月      | 7.13%    | 0.92%       | 8.08%      | 0.96%         | -0.95% | -0.04% |
| 过去一年       | -4.06%   | 1.61%       | -0.12%     | 1.66%         | -3.94% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.40%   | 1.46%       | 3.60%      | 1.52%         | -9.00% | -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 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金，1 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：深证成长 40ETF 及大成深证成长 40ETF 联接基金，1 只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数基金及 21 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成景恒保本



混合型证券投资基金。

#### 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      | -    | 8年     | 金融学硕士。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员；2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日开始担任大成标普 500 等权重指数型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。 |

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期内无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

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，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司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 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对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。2012 年上半年，公司旗下主动投资组合间股票交易存在两笔同日反向交易，与市场成交情况比较，两笔交易成交均价与市场均价不存在明显差异，且同日反向交易成交较少的单边交易量占该股当日市场成交量比例均低于 1%。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，其中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% 的情况有 3 次，原因是指数型投资组合投资策略需要；投资组合间存在债券同日反向交易，但投资组合间的交易价格比较一致，与市场成交均价较为接近，且各投资组合成交量占市场成交量比例不足 5%，基于此公司认为，投资组合间债券的同日反向交易不存在异常交易行为；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；而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，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

2012 年上半年，国际宏观经济及金融领域出现了纷繁多变的局势。

在本年第一季度，欧洲主权债务危机有所缓解。一方面，希腊、西班牙及意大利等多个陷入财政困境的国家均采取了程度各异的财政紧缩政策以恢复市场信心；另一方面，以欧洲央行为主导的众多国际金融组织采取了多项救助政策，尤其是欧洲央行的 LTRO 政策卓有成效。因此，意大利、西班牙等国的政府债券收益率水平出现显著下降，欧洲主权债务危机暂时有所缓解。

同期，美国的宏观经济持续走强，主要特征包括了劳动力市场逐步改善、住宅市场初步回暖、个人收入及消费持续增长。在此多重因素的刺激下，美国一季度的各项宏观经济指标都保持在较佳的水平上。

但是，进入到第二季度后，欧洲主权债务危机又一次加剧。希腊动荡的政治局势曾经导致金融市场一度认为其退出欧元区的概率较大；同期西班牙多家大型银行出现危机，并正式提出援助申请，导致意大利、西班牙的国债收益率创出欧债危机以来的新高。欧洲金融体系的动荡严重影响到了欧洲的实体经济，欧洲经济出现快速萎缩的局面。

在第二季度，受到欧洲经济局势的影响，美国经济增长的步伐也开始放缓。耐用品订单出现减少，劳动力市场持续改善的局势也得以中止。但是，美国的经济状况仍然是大型发达经济体中最好的之一，美国的经济仍然处于正增长之中，尚未出现经济衰退的征兆。

在本报告期内，本基金的目标指数上涨 8.08%，美元兑人民币中间价上涨 0.38%，本基金净值上涨 7.13%，低于经汇率调整后的目标指数 1.36%。在本报告期，本基金的经汇率调整后的年化跟踪误差为 1.19%，日均偏差绝对值为 0.06%，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 0.946 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.13% 同期业绩比较基准收益率为 8.08%，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

欧债危机的前景仍然扑朔迷离。虽然今年六月底的欧盟峰会迈出了创建运行更完善欧元区所需的治理结构的漫漫长路上的重要一步，并承诺了对西班牙银行体系的救助，但是，西班牙及意大利的状况持续恶化，致使欧债危机的前景尚不明朗。

美国的经济数据显示美国的增长速度已然放缓，但是除了美国各级政府之外的实体经济各部

门的资产负债表都比较健康，而且美国的房地产市场预计已经有触底回升的迹象。因此，在欧债危机可控的情况下，美国经济仍有望实现正增长。

同时，美联储依然对刺激经济增长保持积极的态度，一旦美国的经济增长出现了较大的潜在风险，美联储有极大的可能性会推出新一轮量化宽松政策以刺激经济增长。

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，继续深入研究更为高效的组合管理策略、交易策略及风险控制方法，以期更好的跟踪指数，力争将跟踪误差控制在较低的水平。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成标普 500 等权重指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.2.1    | 8,218,189.05                   | 8,206,414.51                     |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.2.2    | 117,101,196.45                 | 125,728,789.60                   |
| 其中：股票投资         |            | 117,101,196.45                 | 125,728,789.60                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 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         |            | -                              | 363,326.40                       |
| 应收利息            | 6.4.2.5    | 213.34                         | 746.12                           |
| 应收股利            |            | 146,186.21                     | 191,040.70                       |
| 应收申购款           |            | 49,489.77                      | 156,946.28                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.2.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 125,515,274.82                 | 134,647,263.61                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2012 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2011 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.2.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 347,693.92                     | -                                |
| 应付赎回款           |            | 456,860.96                     | 1,485,945.78                     |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬       |          | 99,131.49      | 113,815.16     |
| 应付托管费         |          | 24,782.87      | 28,453.78      |
| 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  | 212,557.58     | 224,431.88     |
| 负债合计          |          | 1,141,026.82   | 1,852,646.60   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.2.9  | 131,452,444.92 | 150,455,310.00 |
| 未分配利润         | 6.4.2.10 | -7,078,196.92  | -17,660,692.99 |
| 所有者权益合计       |          | 124,374,248.00 | 132,794,617.01 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 125,515,274.82 | 134,647,263.61 |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.946 元，基金份额总额 131,452,444.92 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 3 月 23 日(基金<br>合同生效日)至 2011 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>            |          | 11,002,136.23                            | 279,213.74  |
| 1. 利息收入                |          | 13,490.66                                | 2,337,310.01  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.2.11 | 13,451.52                                | 2,337,310.01  |
| 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                 |          | 39.14                                    | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 1,690,451.38                             | -27,764.91  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.2.12 | 597,540.40                               | -457,355.64   |
| 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             |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.2.15 | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.2.16 | 1,092,910.98                             | 429,590.73  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.2.17 | 9,275,416.14                             | -2,620,648.87   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -28,317.45                               | -228,945.63   |



|                            |               |                 |                  |
|----------------------------|---------------|-----------------|------------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6. 4. 2. 18   | 51, 095. 50     | 819, 263. 14     |
| <b>减：二、费用</b>              |               | 1, 121, 983. 40 | 1, 541, 884. 11  |
| 1. 管理人报酬                   | 6. 4. 5. 1. 1 | 662, 407. 76    | 1, 090, 291. 61  |
| 2. 托管费                     | 6. 4. 5. 1. 2 | 165, 601. 93    | 272, 572. 88     |
| 3. 销售服务费                   |               | -               | -                |
| 4. 交易费用                    | 6. 4. 2. 19   | 14, 703. 30     | 63, 240. 02      |
| 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. 20   | 279, 270. 41    | 115, 779. 60     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |               | 9, 880, 152. 83 | -1, 262, 670. 37 |
| 减：所得税费用                    |               | -               | -                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |               | 9, 880, 152. 83 | -1, 262, 670. 37 |

### 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：2012 年 1 月 1 日 至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |                   |                   |
|--|---------------------------------------|-------------------|-------------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 150, 455, 310. 00                     | -17, 660, 692. 99 | 132, 794, 617. 01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                     | 9, 880, 152. 83   | 9, 880, 152. 83   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -19, 002, 865. 08                     | 702, 343. 24      | -18, 300, 521. 84 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 27, 688, 859. 66                      | -1, 084, 714. 53  | 26, 604, 145. 13  |
| 2. 基金赎回款                               | -46, 691, 724. 74                     | 1, 787, 057. 77   | -44, 904, 666. 97 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 131, 452, 444. 92                     | -7, 078, 196. 92  | 124, 374, 248. 00 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2011 年 3 月 23 (基金合同生效日) 日至 2011 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)                        | 822,754,222.26  | -             | 822,754,222.26  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | -1,262,670.37 | -1,262,670.37   |
| 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)      | -651,809,447.83                                       | -1,111,219.43 | -652,920,667.26 |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,517,817.46  | -28,851.04    | 2,488,966.42    |
| 2.基金赎回款                                | -654,327,265.29                                       | -1,082,368.39 | -655,409,633.68 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -   | -             | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 170,944,774.43  | -2,373,889.80 | 168,570,884.63  |

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王颢 主管会计工作负责人：刘彩晖 会计机构负责人：范瑛

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计税项与最近一期年度报告相一致。

### 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<br>2012 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 8,218,189.05           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 8,218,189.05           |

#### 6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 |                |               |
|--------|------------------------|----------------|---------------|
|        | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票     | 124,846,520.99         | 117,101,196.45 | -7,745,324.54 |
| 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     | 124,846,520.99         | 117,101,196.45 | -7,745,324.54 |

#### 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

##### 6.4.2.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.2.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 213.34                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | -                      |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 213.34                 |

#### 6.4.2.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。



#### 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<br>2012年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 1,078.32          |
| 预提信息披露费     | 149,179.94        |
| 预提审计费       | 35,803.04         |
| 预提指数使用费     | 26,496.28         |
| 合计          | 212,557.58        |

#### 6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 150,455,310.00             | 150,455,310.00 |
| 本期申购          | 27,688,859.66              | 27,688,859.66  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -46,691,724.74             | -46,691,724.74 |
| 本期末           | 131,452,444.92             | 131,452,444.92 |

#### 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           | -2,409,977.36 | -15,250,715.63 | -17,660,692.99 |
| 本期利润           | 604,736.69    | 9,275,416.14   | 9,880,152.83   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 301,357.94    | 400,985.30     | 702,343.24     |
| 其中：基金申购款       | -472,621.54   | -612,092.99    | -1,084,714.53  |
| 基金赎回款          | 773,979.48    | 1,013,078.29   | 1,787,057.77   |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | -1,503,882.73 | -5,574,314.19  | -7,078,196.92  |

#### 6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 13,451.52                  |
| 定期存款利息收入 | -                          |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 其他存款利息收入  | -         |
| 结算备付金利息收入 | -         |
| 其他        | -         |
| 合计        | 13,451.52 |

#### 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                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 30,553,752.88                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 29,956,212.48                   |
| 买卖股票差价收入   | 597,540.40                      |

#### 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 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.2.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,092,910.98                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               |
| 合计          | 1,092,910.98                    |

#### 6.4.2.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 9,275,416.14                    |
| ——股票投资     | 9,275,416.14                    |
| ——债券投资     | -                               |
| ——资产支持证券投资 | -                               |
| ——基金投资     | -                               |
| 2. 衍生工具    | -                               |

|        |              |
|--------|--------------|
| ——权证投资 | -            |
| 3. 其他  | -            |
| 合计     | 9,275,416.14 |

#### 6.4.2.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 51,095.50                             |
| 合计      | 51,095.50                             |

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。

#### 6.4.2.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 14,703.30                             |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 14,703.30                             |

#### 6.4.2.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 35,803.04                             |
| 信息披露费 | 149,179.94                            |
| 指数使用费 | 77,698.86                             |
| 银行汇划费 | 4,342.95                              |
| 其他    | 12,245.62                             |
| 合计    | 279,270.41                            |

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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、基金代销机构        |
| 中国银行(香港)股份有限公司<br>(“中银香港”) | 境外资产托管人             |
| 中泰信托有限责任公司                 | 基金管理人的股东            |
| 光大证券股份有限公司(“光大证券”)         | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 中国银河投资管理有限公司               | 基金管理人的股东            |
| 广东证券股份有限公司(“广东证券”)         | 基金管理人的股东            |

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

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.5 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<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)<br>至 2011 年 6 月 30 日 |
|---------------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付<br>的管理费  | 662,407.76                               | 1,090,291.61   |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 278,974.84                               | 424,359.90   |

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

###### 6.4.5.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 3 月 23 日(基金合同生效日)<br>至 2011 年 6 月 30 日 |
|--------------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付<br>的托管费 | 165,601.93                               | 272,572.88   |

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

本报告期及上年度可比期间内本基金未发生各关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.5.4 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                        |              |
|-------|----------------------|-----------|--------------------------------|--------------|
|       | 2012年1月1日至2012年6月30日 |           | 2011年3月23日(基金合同生效日)至2011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  | 6,553,575.62         | -         | 2,217,429.02                   | -            |
| 中国银行  | 1,664,613.43         | 13,451.52 | 13,986,083.35                  | 2,337,310.01 |

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

本报告期及上年度可比期间内本基金无利润分配。

#### 6.4.7 期末(2012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 2012 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券。

#### 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<br>2012 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                     | 8,218,189.05 | -     | -     | -              | 8,218,189.05   |
| 存出保证金                    | -            | -     | -     | -              | -              |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 117,101,196.45 | 117,101,196.45 |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 213.34         | 213.34         |
| 应收股利                     | -            | -     | -     | 146,186.21     | 146,186.21     |
| 应收申购款                    | 6,398.35     | -     | -     | 43,091.42      | 49,489.77      |
| 资产总计                     | 8,224,587.40 | -     | -     | 117,290,687.42 | 125,515,274.82 |
| 负债                       |              |       |       |                |                |
| 应付证券清算款                  | -            | -     | -     | 347,693.92     | 347,693.92     |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 456,860.96     | 456,860.96     |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 99,131.49      | 99,131.49      |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 24,782.87      | 24,782.87      |
| 应付交易费用                   | -            | -     | -     | -              | -              |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 212,557.58     | 212,557.58     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 1,141,026.82   | 1,141,026.82   |
| 利率敏感度缺口                  | 8,224,587.40 | -     | -     | 116,149,660.60 | 124,374,248.00 |
| 上年度末<br>2011 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                     | 8,206,414.51 | -     | -     | -              | 8,206,414.51   |
| 结算备付金                    | -            | -     | -     | -              | -              |
| 存出保证金                    | -            | -     | -     | -              | -              |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 125,728,789.60 | 125,728,789.60 |
| 应收证券清算款                  | -            | -     | -     | 363,326.40     | 363,326.40     |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 746.12         | 746.12         |
| 应收股利                     | -            | -     | -     | 191,040.70     | 191,040.70     |
| 应收申购款                    | 63,875.66    | -     | -     | 93,070.62      | 156,946.28     |

|         |              |   |   |                |                |
|---------|--------------|---|---|----------------|----------------|
| 资产总计    | 8,270,290.17 | - | - | 126,376,973.44 | 134,647,263.61 |
| 负债      |              |   |   |                |                |
| 应付赎回款   | -            | - | - | 1,485,945.78   | 1,485,945.78   |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 113,815.16     | 113,815.16     |
| 应付托管费   | -            | - | - | 28,453.78      | 28,453.78      |
| 其他负债    | -            | - | - | 224,431.88     | 224,431.88     |
| 负债总计    | -            | - | - | 1,852,646.60   | 1,852,646.60   |
| 利率敏感度缺口 | 8,270,290.17 | - | - | 124,524,326.84 | 132,794,617.01 |

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

#### 6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 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。于 2011 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。

#### 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<br>2012 年 6 月 30 日   |             |               |                |
|---------------|--------------------------|-------------|---------------|----------------|
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                          |             |               |                |
| 银行存款          | 6,553,575.62             | -           | -             | 6,553,575.62   |
| 交易性金融资产       | 117,101,196.45           | -           | -             | 117,101,196.45 |
| 应收股利          | 146,186.21               | -           | -             | 146,186.21     |
| 资产合计          | 123,800,958.28           | -           | -             | 123,800,958.28 |
| 以外币计价的负债      |                          |             |               |                |
| 应付证券清算款       | 347,693.92               | -           | -             | 347,693.92     |
| 负债合计          | 347,693.92               | -           | -             | 347,693.92     |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 123,453,264.36           | -           | -             | 123,453,264.36 |
| 项目            | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |             |               |                |
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                          |             |               |                |
| 银行存款          | 4,820,314.52             | -           | -             | 4,820,314.52   |
| 交易性金融资产       | 125,728,789.60           | -           | -             | 125,728,789.60 |



|               |                |   |   |                |
|---------------|----------------|---|---|----------------|
| 应收股利          | 191,040.70     | - | - | 191,040.70     |
| 应收证券清算款       | 363,326.40     | - | - | 363,326.40     |
| 资产合计          | 131,103,471.22 | - | - | 131,103,471.22 |
| 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 | 131,103,471.22 | - | - | 131,103,471.22 |

#### 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：人民币元） |                   |
|    |                  | 本期末（2012年6月30日）             | 上年度末（2011年12月31日） |
|    | 美元相对人民币升值 5%     | 6,170,000.00                | 6,560,000.00      |
|    | 美元相对人民币贬值 5%     | -6,170,000.00               | -6,560,000.00     |

#### 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<br>2012年6月30日 |               | 上年度末<br>2011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 | 117,101,196.45    | 94.15         | 125,728,789.60      | 94.68         |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                 | 0.00          | -                   | 0.00          |

|              |                |       |                |       |
|--------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—债券投资 | -              | 0.00  | -              | 0.00  |
| 衍生金融资产—权证投资  | -              | 0.00  | -              | 0.00  |
| 其他           | -              | 0.00  | -              | 0.00  |
| 合计           | 117,101,196.45 | 94.15 | 125,728,789.60 | 94.68 |

#### 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：人民币元） |                   |
|    |                      | 本期末（2012年6月30日）             | 上年度末（2011年12月31日） |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%       | 5,860,000.00                | 6,140,000.00      |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | -5,860,000.00               | -6,140,000.00     |

#### 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              | 117,101,196.45 | 93.30        |
|    | 其中：普通股票           | 117,101,196.45 | 93.30        |
|    | 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 | 8,218,189.05   | 6.55   |
| 8 | 其他各项资产       | 195,889.32     | 0.16   |
| 9 | 合计           | 125,515,274.82 | 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           | 占基金资产净值比列(%) |
|--------|----------------|--------------|
| 美国     | 117,101,196.45 | 94.15        |
| 合计     | 117,101,196.45 | 94.15        |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别    | 公允价值           | 占基金资产净值比列(%) |
|---------|----------------|--------------|
| 金融      | 19,179,294.25  | 15.42        |
| 消费者非必需品 | 18,787,837.19  | 15.11        |
| 信息技术    | 16,241,334.04  | 13.06        |
| 工业      | 14,096,478.75  | 11.33        |
| 医疗保健    | 12,345,640.38  | 9.93         |
| 能源      | 10,375,368.43  | 8.34         |
| 消费者常用品  | 9,731,922.98   | 7.82         |
| 公用事业    | 7,447,247.50   | 5.99         |
| 基础材料    | 6,986,121.00   | 5.62         |
| 电信服务    | 1,909,951.93   | 1.54         |
| 合计      | 117,101,196.45 | 94.15        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                   | 公司名称(中文)   | 证券代码    | 所在证券市场  | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值       | 占基金资产净值比列(%) |
|----|----------------------------|------------|---------|---------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | Constellation Brands Inc A | 星座公司       | STZ UN  | 纽约交易所   | US       | 1,873 | 320,567.31 | 0.26         |
| 2  | News Corporation           | 新闻集团       | NWSA UQ | 纳斯达克交易所 | US       | 1,959 | 276,183.78 | 0.22         |
| 3  | Cabot Oil & Gas A          | 卡伯特石油天然气公司 | COG UN  | 纽约交易所   | US       | 1,098 | 273,622.76 | 0.22         |
| 4  | Pulte Group Inc            | Pulte 集团公司 | PHM UN  | 纽约交易所   | US       | 4,033 | 272,939.04 | 0.22         |
| 5  | Marathon                   | 马拉松石油公     | MPC UN  | 纽约交易所   | US       | 960   | 272,749.93 | 0.22         |

|    |                              |                         |         |         |    |        |            |      |
|----|------------------------------|-------------------------|---------|---------|----|--------|------------|------|
|    | Petroleum Corp.              | 司                       |         |         |    |        |            |      |
| 6  | Southwestern Energy Co       | 西南能源公司                  | SWN UN  | 纽约交易所   | US | 1,341  | 270,820.39 | 0.22 |
| 7  | First Solar Inc              | 福思第一太阳能公司               | FSLR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,838  | 270,328.00 | 0.22 |
| 8  | Lennar Corp                  | Lennar 公司               | LEN UN  | 纽约交易所   | US | 1,364  | 266,665.63 | 0.21 |
| 9  | Vulcan Materials Co          | Vulcan 材料公司             | VMC UN  | 纽约交易所   | US | 1,061  | 266,482.65 | 0.21 |
| 10 | Edwards Lifesciences Corp    | Edwards Lifesciences 公司 | EW UN   | 纽约交易所   | US | 406    | 265,265.04 | 0.21 |
| 11 | WPX Energy Inc.              | WPX 能源公司                | WPX UN  | 纽约交易所   | US | 2,591  | 265,154.86 | 0.21 |
| 12 | Cablevision Systems Co A     | 有线电视系统公司                | CVC UN  | 纽约交易所   | US | 3,146  | 264,446.22 | 0.21 |
| 13 | Horton, D. R. Inc            | DR Horton 公司            | DHI UN  | 纽约交易所   | US | 2,268  | 263,658.77 | 0.21 |
| 14 | CF Industries Holdings       | CF 工业控股股份有限公司           | CF UN   | 纽约交易所   | US | 215    | 263,458.02 | 0.21 |
| 15 | Davita Inc                   | DaVita 公司               | DVA UN  | 纽约交易所   | US | 423    | 262,754.25 | 0.21 |
| 16 | Sears Holdings Corp          | 西尔斯控股公司                 | SHLD UQ | 纳斯达克交易所 | US | 695    | 262,429.59 | 0.21 |
| 17 | Nvidia Corp                  | NVIDIA 公司               | NVDA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,998  | 262,055.53 | 0.21 |
| 18 | Valero Energy Corp           | Valero 能源公司             | VLO UN  | 纽约交易所   | US | 1,708  | 260,890.74 | 0.21 |
| 19 | Time Warner Inc              | 时代华纳                    | TWX UN  | 纽约交易所   | US | 1,069  | 260,310.75 | 0.21 |
| 20 | Reynolds American Inc        | 雷诺兹美国                   | RAI UN  | 纽约交易所   | US | 916    | 259,959.21 | 0.21 |
| 21 | QEP Resources                | QEP 资源公司                | QEP UN  | 纽约交易所   | US | 1,364  | 258,556.09 | 0.21 |
| 22 | Johnson & Johnson            | 强生公司                    | JNJ UN  | 纽约交易所   | US | 601    | 256,813.46 | 0.21 |
| 23 | Lab Corp of America Hldgs    | 美国实验控股                  | LH UN   | 纽约交易所   | US | 437    | 255,972.31 | 0.21 |
| 24 | Mosaic Co                    | Mosaic 公司               | MOS UN  | 纽约交易所   | US | 739    | 255,953.78 | 0.21 |
| 25 | Stryker Corp                 | 史赛克公司                   | SYK UN  | 纽约交易所   | US | 734    | 255,800.46 | 0.21 |
| 26 | Tesoro Corp                  | 特索罗公司                   | TSO UN  | 纽约交易所   | US | 1,620  | 255,748.60 | 0.21 |
| 27 | Goodyear Tire & Rubber Co    | 固特异轮胎橡胶                 | GT UN   | 纽约交易所   | US | 3,420  | 255,463.98 | 0.21 |
| 28 | Frontier Communications Corp | 公民通信公司                  | FTR UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 10,533 | 255,155.26 | 0.21 |
| 29 | NRG Energy                   | NRG 能源股份有限公司            | NRG UN  | 纽约交易所   | US | 2,322  | 254,956.21 | 0.20 |
| 30 | Torchmark Corp               | Torchmark 公司            | TMK UN  | 纽约交易所   | US | 796    | 254,500.06 | 0.20 |

|    |                             |                           |         |         |    |       |            |      |
|----|-----------------------------|---------------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 31 | DIRECTV Class A             | DIRECTV 公司                | DTV UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 824   | 254,436.05 | 0.20 |
| 32 | Perrigo Co                  | Perrigo 公司                | PRGO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 341   | 254,350.35 | 0.20 |
| 33 | Tenet Healthcare            | Tenet 保健                  | THC UN  | 纽约交易所   | US | 7,666 | 254,070.22 | 0.20 |
| 34 | EQT Corporation             | EQT 公司                    | EQT UN  | 纽约交易所   | US | 748   | 253,724.88 | 0.20 |
| 35 | Zimmer Holdings Inc         | 捷迈控股                      | ZMH UN  | 纽约交易所   | US | 622   | 253,197.89 | 0.20 |
| 36 | Campbell Soup Co            | 金宝汤公司                     | CPB UN  | 纽约交易所   | US | 1,199 | 253,139.07 | 0.20 |
| 37 | Time Warner Cable Inc       | 时代华纳有线公司                  | TWC UN  | 纽约交易所   | US | 487   | 252,886.58 | 0.20 |
| 38 | Gannett Co Inc              | 甘乃特公司                     | GCI UN  | 纽约交易所   | US | 2,709 | 252,386.09 | 0.20 |
| 39 | AmerisourceBergesen Corp    | 美源伯根公司                    | ABC UN  | 纽约交易所   | US | 1,014 | 252,369.20 | 0.20 |
| 40 | Weyerhaeuser Co             | 惠好公司                      | WY UN   | 纽约交易所   | US | 1,784 | 252,301.78 | 0.20 |
| 41 | Murphy Oil Corp             | 墨菲石油公司                    | MUR UN  | 纽约交易所   | US | 793   | 252,236.82 | 0.20 |
| 42 | Northern Trust Corp (IL)    | 北美信托                      | NTRS UQ | 纳斯达克交易所 | US | 865   | 251,777.19 | 0.20 |
| 43 | Zions Bancorp (UT)          | Zions 银行                  | ZION UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,046 | 251,309.28 | 0.20 |
| 44 | Raytheon Co                 | 雷神公司                      | RTN UN  | 纽约交易所   | US | 702   | 251,264.12 | 0.20 |
| 45 | Express Scripts Holding Co. | 快捷药方                      | ESRX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 711   | 251,067.73 | 0.20 |
| 46 | SunTrust Banks Inc (GA)     | SunTrust 银行               | STI UN  | 纽约交易所   | US | 1,633 | 250,261.05 | 0.20 |
| 47 | Philip Morris International | 菲利普莫里斯国际集团公司              | PM UN   | 纽约交易所   | US | 453   | 250,015.58 | 0.20 |
| 48 | First Horizon National Corp | First Horizon National 公司 | FHN UN  | 纽约交易所   | US | 4,565 | 249,752.91 | 0.20 |
| 49 | Bank of America Corp        | 美国银行                      | BAC UN  | 纽约交易所   | US | 4,827 | 249,737.79 | 0.20 |
| 50 | Federated Investors Inc B   | 联合投资                      | FII UN  | 纽约交易所   | US | 1,802 | 249,034.72 | 0.20 |
| 51 | Citrix Systems Inc          | 思杰系统                      | CTXS UQ | 纳斯达克交易所 | US | 469   | 248,997.78 | 0.20 |
| 52 | Watson Pharmaceuticals      | 华生制药                      | WPI UN  | 纽约交易所   | US | 532   | 248,965.01 | 0.20 |
| 53 | General Electric Co         | 通用电气                      | GE UN   | 纽约交易所   | US | 1,886 | 248,595.39 | 0.20 |
| 54 | CenturyLink Inc             | CenturyLink 公司            | CTL UN  | 纽约交易所   | US | 995   | 248,521.45 | 0.20 |
| 55 | Merck & Co Inc              | 默克                        | MRK UN  | 纽约交易所   | US | 941   | 248,484.77 | 0.20 |
| 56 | Quest                       | Quest                     | DGX UN  | 纽约交易所   | US | 655   | 248,154.29 | 0.20 |

|    |                          |                      |         |         |    |       |            |      |
|----|--------------------------|----------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
|    | Diagnostics              | Diagnostics 公司       |         |         |    |       |            |      |
| 57 | CVS Caremark Corp.       | CVS 公司               | CVS UN  | 纽约交易所   | US | 839   | 247,977.00 | 0.20 |
| 58 | Ventas Inc               | Ventas 公司            | VTR UN  | 纽约交易所   | US | 621   | 247,920.39 | 0.20 |
| 59 | Lorillard Inc            | Lorillard 公司         | LO UN   | 纽约交易所   | US | 297   | 247,867.45 | 0.20 |
| 60 | Donnelley, R.R. & Sons   | R.R. 当纳利父子           | RRD UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 3,328 | 247,749.87 | 0.20 |
| 61 | Nabors Industries Ltd    | Nabors Industries 公司 | NBR UN  | 纽约交易所   | US | 2,717 | 247,460.45 | 0.20 |
| 62 | United States Steel Corp | 美国钢铁                 | X UN    | 纽约交易所   | US | 1,899 | 247,426.29 | 0.20 |
| 63 | Norfolk Southern Corp    | 诺福克南方                | NSC UN  | 纽约交易所   | US | 545   | 247,396.25 | 0.20 |
| 64 | Exxon Mobil Corp         | 艾克森美孚石油              | XOM UN  | 纽约交易所   | US | 457   | 247,338.31 | 0.20 |
| 65 | Intl Game Technology     | 国际游戏技术               | IGT UN  | 纽约交易所   | US | 2,482 | 247,249.83 | 0.20 |
| 66 | KLA-Tencor Corporation   | Kla-Tencor 公司        | KLAC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 793   | 247,020.55 | 0.20 |
| 67 | Intuit Inc               | Intuit 公司            | INTU UQ | 纳斯达克交易所 | US | 658   | 247,001.89 | 0.20 |
| 68 | Union Pacific Corp       | 联合太平洋                | UNP UN  | 纽约交易所   | US | 327   | 246,761.99 | 0.20 |
| 69 | CareFusion Corp.         | CareFusion 公司        | CFN UN  | 纽约交易所   | US | 1,519 | 246,721.19 | 0.20 |
| 70 | Bard, C.R. Inc           | CR 巴德公司              | BCR UN  | 纽约交易所   | US | 363   | 246,675.65 | 0.20 |
| 71 | Micron Technology Inc    | 美光技术公司               | MU UQ   | 纳斯达克交易所 | US | 6,180 | 246,644.54 | 0.20 |
| 72 | CA Inc                   | 冠群国际                 | CA UQ   | 纳斯达克交易所 | US | 1,439 | 246,560.48 | 0.20 |
| 73 | XL Group Plc             | XL 集团公司              | XL UN   | 纽约交易所   | US | 1,850 | 246,190.41 | 0.20 |
| 74 | Deere & Co               | 迪尔公司                 | DE UN   | 纽约交易所   | US | 481   | 246,028.93 | 0.20 |
| 75 | M&T Bank Corp            | M&T 银行               | MTB UN  | 纽约交易所   | US | 471   | 245,978.33 | 0.20 |
| 76 | Boeing Co                | 波音公司                 | BA UN   | 纽约交易所   | US | 523   | 245,778.66 | 0.20 |
| 77 | Entergy Corp             | Entergy 公司           | ETR UN  | 纽约交易所   | US | 572   | 245,615.35 | 0.20 |
| 78 | Costco Wholesale Corp    | 好市多批发                | COST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 408   | 245,153.12 | 0.20 |
| 79 | McCormick & Co           | 味好美                  | MKC UN  | 纽约交易所   | US | 639   | 245,123.71 | 0.20 |
| 80 | Block H & R Inc          | H&R Block 公司         | HRB UN  | 纽约交易所   | US | 2,425 | 245,099.36 | 0.20 |
| 81 | FedEx Corp               | 联邦快递                 | FDX UN  | 纽约交易所   | US | 423   | 245,096.39 | 0.20 |

|     |                               |                 |         |         |    |       |            |      |
|-----|-------------------------------|-----------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 82  | T Rowe Price Group Inc        | T Rowe Price 公司 | TROW UQ | 纳斯达克交易所 | US | 615   | 244,902.66 | 0.20 |
| 83  | US Bancorp                    | US Bancorp 公司   | USB UN  | 纽约交易所   | US | 1,203 | 244,700.77 | 0.20 |
| 84  | Quanta Services Inc           | Quanta 服务股份有限公司 | PWR UN  | 纽约交易所   | US | 1,607 | 244,650.23 | 0.20 |
| 85  | Jabil Circuit Inc             | 捷普科技            | JBL UN  | 纽约交易所   | US | 1,902 | 244,569.08 | 0.20 |
| 86  | Comerica Inc (MI)             | Comerica 公司     | CMA UN  | 纽约交易所   | US | 1,259 | 244,545.24 | 0.20 |
| 87  | Morgan Stanley                | 摩根士丹利           | MS UN   | 纽约交易所   | US | 2,650 | 244,542.77 | 0.20 |
| 88  | Northrop Grumman Corp         | 诺斯洛普格鲁曼         | NOC UN  | 纽约交易所   | US | 606   | 244,500.01 | 0.20 |
| 89  | Alexion Pharmaceuticals Inc   | Alexion 制药公司    | ALXN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 389   | 244,316.34 | 0.20 |
| 90  | Regions Financial Corp        | Regions 金融      | RF UN   | 纽约交易所   | US | 5,722 | 244,289.78 | 0.20 |
| 91  | Ameriprise Financial Inc      | 阿默普莱斯金融公司       | AMP UN  | 纽约交易所   | US | 739   | 244,268.52 | 0.20 |
| 92  | Dun & Bradstreet Corp         | 邓白氏公司           | DNB UN  | 纽约交易所   | US | 542   | 243,977.58 | 0.20 |
| 93  | Abercrombie & Fitch Company A | 阿贝克隆比&费奇公司      | ANF UN  | 纽约交易所   | US | 1,129 | 243,787.33 | 0.20 |
| 94  | Wells Fargo & Co              | 富国银行            | WFC UN  | 纽约交易所   | US | 1,152 | 243,653.36 | 0.20 |
| 95  | BB&T Corp                     | BB&T 公司         | BBT UN  | 纽约交易所   | US | 1,248 | 243,513.71 | 0.20 |
| 96  | L-3 Communications Holdings   | L-3 通讯控股        | LLL UN  | 纽约交易所   | US | 520   | 243,415.04 | 0.20 |
| 97  | Brown-Forman Corp B           | 布朗福曼公司          | BF/B UN | 纽约交易所   | US | 397   | 243,188.93 | 0.20 |
| 98  | CSX Corp                      | CSX 公司          | CSX UN  | 纽约交易所   | US | 1,718 | 242,967.74 | 0.20 |
| 99  | Apache Corp                   | 阿帕契公司           | APA UN  | 纽约交易所   | US | 437   | 242,926.32 | 0.20 |
| 100 | CONSOL Energy Inc             | CONSOL 能源公司     | CNX UN  | 纽约交易所   | US | 1,270 | 242,906.52 | 0.20 |
| 101 | Sysco Corp                    | Sysco 公司        | SYU UN  | 纽约交易所   | US | 1,288 | 242,846.31 | 0.20 |
| 102 | Omnicom Group                 | 奥姆尼康            | OMC UN  | 纽约交易所   | US | 790   | 242,838.21 | 0.20 |
| 103 | Amazon.com Inc                | 亚马逊公司           | AMZN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 168   | 242,640.87 | 0.20 |
| 104 | Plum Creek Timber Co          | Plum Creek 林业   | PCL UN  | 纽约交易所   | US | 966   | 242,561.18 | 0.20 |
| 105 | Amgen Inc                     | 安进              | AMGN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 525   | 242,534.62 | 0.20 |
| 106 | State Street Corp             | 道富集团            | STT UN  | 纽约交易所   | US | 859   | 242,533.10 | 0.20 |
| 107 | McKesson Corp                 | McKesson 公司     | MCK UN  | 纽约交易所   | US | 409   | 242,520.38 | 0.19 |
| 108 | Accenture plc                 | Accenture 公司    | ACN UN  | 纽约交易所   | US | 638   | 242,480.35 | 0.19 |



|     |                               |                  |          |         |    |        |            |      |
|-----|-------------------------------|------------------|----------|---------|----|--------|------------|------|
| 109 | Visa Inc                      | 维萨公司             | V UN     | 纽约交易所   | US | 310    | 242,403.69 | 0.19 |
| 110 | Discovery Communications Inc  | 探索传播公司           | DISCA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 709    | 242,155.12 | 0.19 |
| 111 | Molson Coors Brewing Co B     | 莫尔森-康胜公司         | TAP UN   | 纽约交易所   | US | 920    | 242,124.76 | 0.19 |
| 112 | General Mills Inc             | 通用磨坊公司           | GIS UN   | 纽约交易所   | US | 993    | 242,055.31 | 0.19 |
| 113 | Intel Corp                    | 英特尔              | INTC UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,435  | 241,881.57 | 0.19 |
| 114 | Comcast Corp                  | 康卡斯特             | CMCSA UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,196  | 241,839.64 | 0.19 |
| 115 | Allegheny Technologies Inc    | 冶联科技             | ATI UN   | 纽约交易所   | US | 1,199  | 241,839.57 | 0.19 |
| 116 | Range Resources Corp          | Range 资源公司       | RRC UN   | 纽约交易所   | US | 618    | 241,836.73 | 0.19 |
| 117 | Genworth Financial Inc        | Genworth 金融公司    | GNW UN   | 纽约交易所   | US | 6,754  | 241,786.00 | 0.19 |
| 118 | DeVry Inc                     | 迪弗莱公司            | DV UN    | 纽约交易所   | US | 1,234  | 241,718.58 | 0.19 |
| 119 | AGL Resources                 | AGL Resources 公司 | GAS UN   | 纽约交易所   | US | 986    | 241,658.62 | 0.19 |
| 120 | Dean Foods Co                 | Dean 食品公司        | DF UN    | 纽约交易所   | US | 2,243  | 241,600.36 | 0.19 |
| 121 | Becton, Dickinson & Co        | 碧迪公司             | BDX UN   | 纽约交易所   | US | 511    | 241,593.79 | 0.19 |
| 122 | Aon plc                       | 怡安保险             | AON UN   | 纽约交易所   | US | 816    | 241,437.12 | 0.19 |
| 123 | Praxair Inc                   | 普莱克斯             | PX UN    | 纽约交易所   | US | 351    | 241,384.94 | 0.19 |
| 124 | Cintas Corp                   | CINTAS 公司        | CTAS UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 988    | 241,273.94 | 0.19 |
| 125 | Discover Financial Services   | Discover 金融服务公司  | DFS UN   | 纽约交易所   | US | 1,103  | 241,242.69 | 0.19 |
| 126 | NetApp Inc                    | 网域存储技术           | NTAP UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,198  | 241,107.46 | 0.19 |
| 127 | Fidelity National Information | 富达国民信息服务公司       | FIS UN   | 纽约交易所   | US | 1,118  | 240,987.80 | 0.19 |
| 128 | Sprint Nextel Corp            | 斯普林特             | S UN     | 纽约交易所   | US | 11,685 | 240,935.05 | 0.19 |
| 129 | Pitney Bowes Inc              | Pitney Bowes 公司  | PBI UN   | 纽约交易所   | US | 2,544  | 240,875.47 | 0.19 |
| 130 | JP Morgan Chase & Co          | 摩根大通             | JPM UN   | 纽约交易所   | US | 1,065  | 240,677.94 | 0.19 |
| 131 | Crown Castle Intl Corp        | 冠城国际公司           | CCI UN   | 纽约交易所   | US | 648    | 240,420.07 | 0.19 |



|     |                             |                   |         |         |    |       |            |      |
|-----|-----------------------------|-------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 132 | JDS Uniphase Corp           | 捷迪讯               | JDSU UQ | 纳斯达克交易所 | US | 3,454 | 240,308.25 | 0.19 |
| 133 | Simon Property Group        | Simon Property 公司 | SPG UN  | 纽约交易所   | US | 244   | 240,226.28 | 0.19 |
| 134 | Public Storage              | Public Storage 公司 | PSA UN  | 纽约交易所   | US | 263   | 240,218.63 | 0.19 |
| 135 | ConAgra Foods Inc           | 康尼格拉食品            | CAG UN  | 纽约交易所   | US | 1,464 | 240,102.82 | 0.19 |
| 136 | Teradata Corp               | 美商天睿信息系统有限公司      | TDC UN  | 纽约交易所   | US | 527   | 240,025.34 | 0.19 |
| 137 | Big Lots Inc                | Big Lots 公司       | BIG UN  | 纽约交易所   | US | 930   | 239,933.18 | 0.19 |
| 138 | eBay Inc.                   | 电子湾               | EBAY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 902   | 239,669.56 | 0.19 |
| 139 | McGraw-Hill Cos Inc         | 麦格希               | MHP UN  | 纽约交易所   | US | 842   | 239,650.46 | 0.19 |
| 140 | NetFlix Inc                 | 奈飞公司              | NFLX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 553   | 239,485.44 | 0.19 |
| 141 | Stericycle Inc              | Stericycle 公司     | SRCL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 413   | 239,458.88 | 0.19 |
| 142 | Cerner Corp                 | 塞纳公司              | CERN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 458   | 239,449.84 | 0.19 |
| 143 | Bristol-Myers Squibb        | 百时美施贵宝            | BMJ UN  | 纽约交易所   | US | 1,053 | 239,431.30 | 0.19 |
| 144 | Sigma-Aldrich Corp          | 西格玛-奥德里奇          | SIAL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 512   | 239,411.13 | 0.19 |
| 145 | Fiserv Inc                  | Fiserv 公司         | FISV UQ | 纳斯达克交易所 | US | 524   | 239,354.96 | 0.19 |
| 146 | Fifth Third Bancorp (OH)    | 五三银行              | FITB UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,823 | 239,259.58 | 0.19 |
| 147 | Hershey Foods Corp          | 好时食品              | HSY UN  | 纽约交易所   | US | 525   | 239,180.84 | 0.19 |
| 148 | Akamai Technologies Inc     | 阿卡迈技术公司           | AKAM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,191 | 239,171.35 | 0.19 |
| 149 | AES Corp                    | 爱伊斯               | AES UN  | 纽约交易所   | US | 2,945 | 238,982.24 | 0.19 |
| 150 | Robert Half Intl Inc        | Robert Half 国际    | RHI UN  | 纽约交易所   | US | 1,322 | 238,888.56 | 0.19 |
| 151 | Masco Corp                  | 马斯可               | MAS UN  | 纽约交易所   | US | 2,723 | 238,878.89 | 0.19 |
| 152 | Gap Inc                     | Gap 公司            | GPS UN  | 纽约交易所   | US | 1,380 | 238,807.98 | 0.19 |
| 153 | Washington Post Co B        | 华盛顿邮报公司           | WPO UN  | 纽约交易所   | US | 101   | 238,801.79 | 0.19 |
| 154 | Monsanto Co.                | 孟山都               | MON UN  | 纽约交易所   | US | 456   | 238,750.30 | 0.19 |
| 155 | Intl Business Machines Corp | 国际商业机器            | IBM UN  | 纽约交易所   | US | 193   | 238,745.62 | 0.19 |
| 156 | Jacobs                      | 雅各布工程集            | JEC UN  | 纽约交易所   | US | 997   | 238,742.33 | 0.19 |

|     |                          |                  |         |         |    |       |            |      |
|-----|--------------------------|------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
|     | Engineering Group Inc    | 团                |         |         |    |       |            |      |
| 157 | Red Hat Inc              | 红帽公司             | RHT UN  | 纽约交易所   | US | 668   | 238,629.88 | 0.19 |
| 158 | Mattel Inc               | 美泰               | MAT UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,163 | 238,624.06 | 0.19 |
| 159 | 3M Co                    | 3M 公司            | MMM UN  | 纽约交易所   | US | 421   | 238,585.35 | 0.19 |
| 160 | Health Care REIT Inc     | 医疗保健 REIT        | HCN UN  | 纽约交易所   | US | 647   | 238,575.86 | 0.19 |
| 161 | American Express Co      | 美国运通             | AXP UN  | 纽约交易所   | US | 648   | 238,575.73 | 0.19 |
| 162 | SLM Corp                 | SLM 公司           | SLM UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 2,400 | 238,474.03 | 0.19 |
| 163 | Oracle Corp              | 甲骨文              | ORCL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,269 | 238,381.05 | 0.19 |
| 164 | Coca-Cola Enterprises    | 可口可乐企业           | CCE UN  | 纽约交易所   | US | 1,344 | 238,358.66 | 0.19 |
| 165 | Biogen Idec Inc          | 生物基因             | BIIB UQ | 纳斯达克交易所 | US | 261   | 238,342.35 | 0.19 |
| 166 | American Tower Corp A    | 美国发射塔公司          | AMT UN  | 纽约交易所   | US | 539   | 238,331.66 | 0.19 |
| 167 | PPG Industries Inc       | PPG 工业公司         | PPG UN  | 纽约交易所   | US | 355   | 238,275.43 | 0.19 |
| 168 | Darden Restaurants Inc   | 达登饭店             | DRI UN  | 纽约交易所   | US | 744   | 238,250.89 | 0.19 |
| 169 | Metlife Inc              | 大都会集团            | MET UN  | 纽约交易所   | US | 1,221 | 238,245.38 | 0.19 |
| 170 | Anadarko Petroleum Corp  | 阿纳达科石油           | APC UN  | 纽约交易所   | US | 569   | 238,245.07 | 0.19 |
| 171 | Whole Foods Market Inc   | 全食超市             | WFM UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 395   | 238,141.34 | 0.19 |
| 172 | Flowserve Corp           | 福斯公司             | FLS UN  | 纽约交易所   | US | 328   | 238,056.59 | 0.19 |
| 173 | Analog Devices Inc       | 模拟器件             | ADI UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 999   | 238,020.72 | 0.19 |
| 174 | Baxter Intl Inc          | 百特               | BAX UN  | 纽约交易所   | US | 708   | 238,007.25 | 0.19 |
| 175 | DuPont, E. I. de Nemours | 杜邦               | DD UN   | 纽约交易所   | US | 744   | 237,968.54 | 0.19 |
| 176 | Best Buy Co Inc          | 百思买              | BBY UN  | 纽约交易所   | US | 1,795 | 237,962.98 | 0.19 |
| 177 | Patterson Cos Inc        | Patterson Cos 公司 | PDCO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,091 | 237,859.06 | 0.19 |
| 178 | Capital One Financial    | 第一资本金融           | COF UN  | 纽约交易所   | US | 688   | 237,854.70 | 0.19 |
| 179 | Colgate-Palmolive Co     | 高露洁棕榄            | CL UN   | 纽约交易所   | US | 361   | 237,690.37 | 0.19 |
| 180 | Eastman Chemical         | 伊士曼化工            | EMN UN  | 纽约交易所   | US | 746   | 237,664.57 | 0.19 |

|     | Co                               |                        |         |         |    |       |            |      |
|-----|----------------------------------|------------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 181 | Waste Management Inc             | 废品管理                   | WM UN   | 纽约交易所   | US | 1,125 | 237,658.12 | 0.19 |
| 182 | HCP Inc                          | HCP 公司                 | HCP UN  | 纽约交易所   | US | 851   | 237,636.93 | 0.19 |
| 183 | Medtronic Inc                    | 美敦力                    | MDT UN  | 纽约交易所   | US | 970   | 237,614.48 | 0.19 |
| 184 | Northeast Utilities              | Northeast Utilities 公司 | NU UN   | 纽约交易所   | US | 968   | 237,614.35 | 0.19 |
| 185 | Baker Hughes Inc                 | 贝克休斯                   | BHI UN  | 纽约交易所   | US | 914   | 237,597.40 | 0.19 |
| 186 | VeriSign Inc                     | 威瑞信公司                  | VRSN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 862   | 237,546.42 | 0.19 |
| 187 | Marriott Intl A                  | 万豪国际                   | MAR UN  | 纽约交易所   | US | 958   | 237,522.76 | 0.19 |
| 188 | Exelon Corp                      | Exelon 公司              | EXC UN  | 纽约交易所   | US | 998   | 237,466.85 | 0.19 |
| 189 | Cincinnati Financial Corp        | 辛辛那提金融                 | CINF UQ | 纳斯达克交易所 | US | 986   | 237,417.90 | 0.19 |
| 190 | Principal Financial Group        | 信安金融                   | PFG UN  | 纽约交易所   | US | 1,431 | 237,405.94 | 0.19 |
| 191 | Dell Inc                         | 戴尔                     | DELL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,998 | 237,404.87 | 0.19 |
| 192 | Lockheed Martin                  | 洛克希德马丁                 | LMT UN  | 纽约交易所   | US | 431   | 237,382.86 | 0.19 |
| 193 | Abbott Laboratories              | 雅培制药                   | ABT UN  | 纽约交易所   | US | 582   | 237,319.99 | 0.19 |
| 194 | Automatic Data Processing        | ADP 公司                 | ADP UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 674   | 237,277.61 | 0.19 |
| 195 | The Bank of New York Mellon Corp | 纽约银行                   | BK UN   | 纽约交易所   | US | 1,709 | 237,263.13 | 0.19 |
| 196 | Amphenol Corp A                  | 安费诺公司                  | APH UN  | 纽约交易所   | US | 683   | 237,249.28 | 0.19 |
| 197 | Dentsply Intl                    | 登士柏国际集团                | XRAY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 992   | 237,231.31 | 0.19 |
| 198 | KeyCorp                          | KeyCorp 公司             | KEY UN  | 纽约交易所   | US | 4,845 | 237,185.65 | 0.19 |
| 199 | Windstream Corp                  | Windstream 公司          | WIN UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 3,882 | 237,184.51 | 0.19 |
| 200 | Starwood Hotel & Resort World    | 喜达屋饭店                  | HOT UN  | 纽约交易所   | US | 707   | 237,179.20 | 0.19 |
| 201 | Hasbro Inc                       | 孩之宝                    | HAS UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,106 | 236,932.15 | 0.19 |
| 202 | Ingersoll-Rand Plc               | 英格索兰                   | IR UN   | 纽约交易所   | US | 888   | 236,904.44 | 0.19 |
| 203 | American Intl Group Inc          | 美国国际集团                 | AIG UN  | 纽约交易所   | US | 1,167 | 236,861.37 | 0.19 |
| 204 | Lilly, Eli & Co                  | 礼来                     | LLY UN  | 纽约交易所   | US | 872   | 236,662.07 | 0.19 |
| 205 | Lincoln National Corp            | 林肯国民                   | LNC UN  | 纽约交易所   | US | 1,710 | 236,536.71 | 0.19 |
| 206 | Danaher Corp                     | 丹纳赫                    | DHR UN  | 纽约交易所   | US | 718   | 236,509.77 | 0.19 |

|     |                             |                      |         |         |    |       |            |      |
|-----|-----------------------------|----------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 207 | SanDisk Corp                | SanDisk 公司           | SNDK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,025 | 236,500.66 | 0.19 |
| 208 | Gilead Sciences Inc         | Gilead 科学            | GILD UQ | 纳斯达克交易所 | US | 729   | 236,444.50 | 0.19 |
| 209 | Coca-Cola Co                | 可口可乐                 | KO UN   | 纽约交易所   | US | 478   | 236,392.00 | 0.19 |
| 210 | Lexmark International Inc   | 利盟国际                 | LXK UN  | 纽约交易所   | US | 1,406 | 236,370.87 | 0.19 |
| 211 | Kimco Realty Corp           | Kimco Realty 公司      | KIM UN  | 纽约交易所   | US | 1,963 | 236,272.27 | 0.19 |
| 212 | Host Hotels & Resorts Inc   | Host 酒店及度假酒店公司       | HST UN  | 纽约交易所   | US | 2,361 | 236,241.47 | 0.19 |
| 213 | EMC Corp                    | EMC 公司               | EMC UN  | 纽约交易所   | US | 1,456 | 236,028.06 | 0.19 |
| 214 | Wal-Mart Stores             | 沃尔玛百货                | WMT UN  | 纽约交易所   | US | 535   | 235,920.03 | 0.19 |
| 215 | NYSE Euronext               | 纽约-泛欧交易所集团           | NYX UN  | 纽约交易所   | US | 1,458 | 235,891.19 | 0.19 |
| 216 | Hospira, Inc                | Hospira 公司           | HSP UN  | 纽约交易所   | US | 1,066 | 235,847.17 | 0.19 |
| 217 | ProLogis, Inc               | 普洛斯公司                | PLD UN  | 纽约交易所   | US | 1,122 | 235,817.95 | 0.19 |
| 218 | Boston Properties Inc       | 波士顿地产公司              | BXP UN  | 纽约交易所   | US | 344   | 235,787.72 | 0.19 |
| 219 | PNC Finl Services Group     | PNC 财务服务             | PNC UN  | 纽约交易所   | US | 610   | 235,773.93 | 0.19 |
| 220 | FMC Corp                    | FMC 公司               | FMC UN  | 纽约交易所   | US | 697   | 235,764.19 | 0.19 |
| 221 | Chicago Mercantile Exchange | 芝加哥商业交易所控股公司         | CME UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 139   | 235,711.88 | 0.19 |
| 222 | Harris Corp                 | 哈里斯公司                | HRS UN  | 纽约交易所   | US | 890   | 235,580.39 | 0.19 |
| 223 | Wyndham Worldwide Corp      | Wyndham 公司           | WYN UN  | 纽约交易所   | US | 706   | 235,504.11 | 0.19 |
| 224 | Leucadia National Corp (NY) | Leucadia National 公司 | LUK UN  | 纽约交易所   | US | 1,750 | 235,428.59 | 0.19 |
| 225 | Priceline.com Inc           | Priceline.com 公司     | PCLN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 56    | 235,369.26 | 0.19 |
| 226 | Huntington Bancshares (OH)  | 杭庭顿银行                | HBAN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 5,814 | 235,347.00 | 0.19 |
| 227 | Walt Disney Co              | 沃尔特迪斯尼               | DIS UN  | 纽约交易所   | US | 767   | 235,283.12 | 0.19 |
| 228 | United Parcel Service Inc B | UPS 公司               | UPS UN  | 纽约交易所   | US | 472   | 235,126.39 | 0.19 |
| 229 | Western Union Co            | 西联汇款                 | WU UN   | 纽约交易所   | US | 2,207 | 235,070.47 | 0.19 |
| 230 | SAIC Inc                    | SAIC 公司              | SAI UN  | 纽约交易所   | US | 3,066 | 235,032.78 | 0.19 |
| 231 | Loews Corp                  | 罗斯                   | L UN    | 纽约交易所   | US | 908   | 234,946.51 | 0.19 |
| 232 | Altria Group Inc            | 高特利                  | MO UN   | 纽约交易所   | US | 1,075 | 234,914.69 | 0.19 |

|     |                               |                        |          |         |    |       |            |      |
|-----|-------------------------------|------------------------|----------|---------|----|-------|------------|------|
| 233 | Microsoft Corp                | 微软                     | MSFT UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,214 | 234,883.13 | 0.19 |
| 234 | Phillips 66                   | Phillips 66 公司         | PSX UN   | 纽约交易所   | US | 1,117 | 234,837.72 | 0.19 |
| 235 | Google Inc                    | 谷歌公司                   | GOOG UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 64    | 234,808.62 | 0.19 |
| 236 | Kinder Morgan Inc             | 特拉华州金德摩根公司             | KMI UN   | 纽约交易所   | US | 1,152 | 234,764.10 | 0.19 |
| 237 | ONEOK Inc                     | Oneok 股份有限公司           | OKE UN   | 纽约交易所   | US | 877   | 234,690.92 | 0.19 |
| 238 | Intuitive Surgical Inc        | 直觉外科手术公司               | ISRG UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 67    | 234,678.65 | 0.19 |
| 239 | Marathon Oil Corp             | 马拉松石油                  | MRO UN   | 纽约交易所   | US | 1,451 | 234,666.88 | 0.19 |
| 240 | Apollo Group Inc              | 阿波罗                    | APOL UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,025 | 234,620.58 | 0.19 |
| 241 | FirstEnergy Corp              | 第一能源                   | FE UN    | 纽约交易所   | US | 754   | 234,585.86 | 0.19 |
| 242 | Berkshire Hathaway B          | 伯克希尔哈撒韦公司              | BRK/B UN | 纽约交易所   | US | 445   | 234,538.99 | 0.19 |
| 243 | Integrus Energy Group Inc     | 英迪斯能源集团公司              | TEG UN   | 纽约交易所   | US | 652   | 234,522.49 | 0.19 |
| 244 | Ecolab Inc                    | 艺康化工                   | ECL UN   | 纽约交易所   | US | 541   | 234,493.96 | 0.19 |
| 245 | Sherwin-Williams Co           | 宣威威廉斯                  | SHW UN   | 纽约交易所   | US | 280   | 234,388.14 | 0.19 |
| 246 | Boston Scientific Corp        | 波士顿科学                  | BSX UN   | 纽约交易所   | US | 6,530 | 234,180.05 | 0.19 |
| 247 | Covidien Plc                  | Covidien 公共股份公司        | COV UN   | 纽约交易所   | US | 692   | 234,160.45 | 0.19 |
| 248 | Hormel Foods Corp             | 荷美尔食品有限公司              | HRL UN   | 纽约交易所   | US | 1,217 | 234,155.01 | 0.19 |
| 249 | Cognizant Tech Solutions Corp | 高知特科技公司                | CTSH UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 617   | 234,147.80 | 0.19 |
| 250 | Mastercard Inc A              | 万事达股份有限公司              | MA UN    | 纽约交易所   | US | 86    | 233,954.64 | 0.19 |
| 251 | Life Technologies Corp        | Life 科技公司              | LIFE UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 822   | 233,906.06 | 0.19 |
| 252 | The Williams Companies Inc    | 威廉姆斯公司                 | WMB UN   | 纽约交易所   | US | 1,283 | 233,869.88 | 0.19 |
| 253 | Dr Pepper Snapple Group       | Dr Pepper Snapple 集团公司 | DPS UN   | 纽约交易所   | US | 845   | 233,823.65 | 0.19 |
| 254 | TJX Cos Inc                   | TJX 公司                 | TJX UN   | 纽约交易所   | US | 861   | 233,785.57 | 0.19 |
| 255 | Total System                  | 全系统服务公                 | TSS UN   | 纽约交易所   | US | 1,544 | 233,691.90 | 0.19 |

|     |                               |                |         |         |    |       |            |      |
|-----|-------------------------------|----------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
|     | Services Inc                  | 司              |         |         |    |       |            |      |
| 256 | PerkinElmer Inc               | 珀金埃尔默          | PKI UN  | 纽约交易所   | US | 1,432 | 233,677.23 | 0.19 |
| 257 | Sempra Energy                 | 桑普拉能源          | SRE UN  | 纽约交易所   | US | 536   | 233,513.28 | 0.19 |
| 258 | Pfizer Inc                    | 辉瑞制药           | PFE UN  | 纽约交易所   | US | 1,605 | 233,483.68 | 0.19 |
| 259 | Fluor Corp                    | 福陆             | FLR UN  | 纽约交易所   | US | 748   | 233,428.78 | 0.19 |
| 260 | Kellogg Co                    | 家乐氏            | K UN    | 纽约交易所   | US | 748   | 233,381.47 | 0.19 |
| 261 | PepsiCo Inc                   | 百事可乐           | PEP UN  | 纽约交易所   | US | 522   | 233,290.90 | 0.19 |
| 262 | NextEra Energy Inc            | 新纪元能源公司        | NEE UN  | 纽约交易所   | US | 536   | 233,275.97 | 0.19 |
| 263 | Allstate Corp                 | 全州保险           | ALL UN  | 纽约交易所   | US | 1,051 | 233,259.72 | 0.19 |
| 264 | Halliburton Co                | 哈利伯顿           | HAL UN  | 纽约交易所   | US | 1,299 | 233,253.52 | 0.19 |
| 265 | Adobe Systems Inc             | 奥多比            | ADBE UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,139 | 233,195.46 | 0.19 |
| 266 | TECO Energy Inc               | TECO 能源        | TE UN   | 纽约交易所   | US | 2,041 | 233,138.72 | 0.19 |
| 267 | Public Service Enterprise Grp | 公共服务企业集团       | PEG UN  | 纽约交易所   | US | 1,134 | 233,104.19 | 0.19 |
| 268 | Intercontinental Exchange     | 洲际交易所公司 (ICE)  | ICE UN  | 纽约交易所   | US | 271   | 233,076.23 | 0.19 |
| 269 | Chubb Corp                    | 丘博集团           | CB UN   | 纽约交易所   | US | 506   | 233,053.08 | 0.19 |
| 270 | ACE Limited                   | ACE 公司         | ACE UN  | 纽约交易所   | US | 497   | 233,025.82 | 0.19 |
| 271 | SCANA Corp                    | SCANA 公司       | SCG UN  | 纽约交易所   | US | 770   | 232,989.08 | 0.19 |
| 272 | Hartford Finl Services Group  | 哈特福德金融服务       | HIG UN  | 纽约交易所   | US | 2,089 | 232,940.18 | 0.19 |
| 273 | Chevron Corp                  | 雪佛龙德士古         | CVX UN  | 纽约交易所   | US | 349   | 232,879.66 | 0.19 |
| 274 | Cisco Systems Inc             | 思科             | CSCO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,144 | 232,835.25 | 0.19 |
| 275 | CBS Corp B                    | 哥伦比亚广播公司       | CBS UN  | 纽约交易所   | US | 1,123 | 232,831.84 | 0.19 |
| 276 | Chesapeake Energy Corp        | 切萨皮克能源公司       | CHK UN  | 纽约交易所   | US | 1,979 | 232,815.77 | 0.19 |
| 277 | 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 | 765   | 232,782.57 | 0.19 |
| 278 | Wisconsin Energy Corp         | 威斯康星能源公司       | WEC UN  | 纽约交易所   | US | 930   | 232,756.95 | 0.19 |
| 279 | Avery Dennison Corp           | 艾利丹尼森          | AVY UN  | 纽约交易所   | US | 1,346 | 232,754.04 | 0.19 |
| 280 | Verizon Communications Inc    | Verizon 通信     | VZ UN   | 纽约交易所   | US | 828   | 232,733.04 | 0.19 |
| 281 | Xerox Corp                    | 施乐             | XRX UN  | 纽约交易所   | US | 4,675 | 232,707.30 | 0.19 |
| 282 | Assurant Inc                  | Assurant 公司    | AIZ UN  | 纽约交易所   | US | 1,056 | 232,699.65 | 0.19 |
| 283 | Vornado Realty                | 沃那多房地产         | VNO UN  | 纽约交易所   | US | 438   | 232,650.31 | 0.19 |

|     | Trust                        | 信托               |         |         |    |       |            |      |
|-----|------------------------------|------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 284 | Home Depot Inc               | 家得宝              | HD UN   | 纽约交易所   | US | 694   | 232,598.58 | 0.19 |
| 285 | Nasdaq OMX Group/The         | 纳斯达克 OMX 集团股份有限公 | NDAQ UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,622 | 232,571.25 | 0.19 |
| 286 | Legg Mason Inc               | Legg Mason 公司    | LM UN   | 纽约交易所   | US | 1,394 | 232,501.93 | 0.19 |
| 287 | TripAdvisor Inc.             | TripAdvisor 公司   | TRIP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 822   | 232,346.34 | 0.19 |
| 288 | Cliffs Natural Resources Inc | 克里夫斯自然资源股份有限公    | CLF UN  | 纽约交易所   | US | 745   | 232,256.97 | 0.19 |
| 289 | Dominion Resources Inc       | 多米诺资源            | D UN    | 纽约交易所   | US | 680   | 232,250.33 | 0.19 |
| 290 | Heinz, H. J. Co              | 亨氏               | HNZ UN  | 纽约交易所   | US | 675   | 232,164.94 | 0.19 |
| 291 | Peabody Energy Corp          | 博地能源公司           | BTU UN  | 纽约交易所   | US | 1,497 | 232,164.56 | 0.19 |
| 292 | Kimberly-Clark               | 金佰利              | KMB UN  | 纽约交易所   | US | 438   | 232,068.55 | 0.19 |
| 293 | Centerpoint Energy Inc       | 中点能源             | CNP UN  | 纽约交易所   | US | 1,775 | 232,055.84 | 0.19 |
| 294 | Linear Technology Corp       | 凌特               | LLTC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,171 | 232,044.33 | 0.19 |
| 295 | Paychex Inc                  | Paychex 公司       | PAYX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,168 | 232,040.85 | 0.19 |
| 296 | Scripps Networks Interactive | 斯克利普斯网络互动公司      | SNI UN  | 纽约交易所   | US | 645   | 231,963.81 | 0.19 |
| 297 | Prudential Financial Inc     | 保德信金融集团          | PRU UN  | 纽约交易所   | US | 757   | 231,880.38 | 0.19 |
| 298 | Pepco Holdings Inc           | Pepco 控股公司       | POM UN  | 纽约交易所   | US | 1,873 | 231,836.74 | 0.19 |
| 299 | Autodesk Inc                 | 欧特克              | ADSK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,047 | 231,709.74 | 0.19 |
| 300 | Yahoo Inc                    | 雅虎               | YHOO UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,314 | 231,685.01 | 0.19 |
| 301 | Expedia                      | 艾派迪公司            | EXPE UQ | 纳斯达克交易所 | US | 762   | 231,676.91 | 0.19 |
| 302 | AFLAC Inc                    | 家庭人寿保险           | AFL UN  | 纽约交易所   | US | 860   | 231,664.64 | 0.19 |
| 303 | Lowes Cos Inc                | 劳氏               | LOW UN  | 纽约交易所   | US | 1,287 | 231,505.76 | 0.19 |
| 304 | St Jude Medical Inc          | 圣犹达医疗用品          | STJ UN  | 纽约交易所   | US | 917   | 231,475.34 | 0.19 |
| 305 | Denbury Resources Inc        | Denbury 资源公司     | DNR UN  | 纽约交易所   | US | 2,422 | 231,468.70 | 0.19 |
| 306 | Noble Corp                   | Noble 公司         | NE UN   | 纽约交易所   | US | 1,125 | 231,467.62 | 0.19 |
| 307 | Yum! Brands Inc              | 百胜全球餐饮           | YUM UN  | 纽约交易所   | US | 568   | 231,431.63 | 0.19 |



|     |                            |                         |         |         |    |        |              |       |
|-----|----------------------------|-------------------------|---------|---------|----|--------|--------------|-------|
| 308 | Avon Products              | 雅芳                      | AVP UN  | 纽约交易所   | US | 2, 257 | 231, 402. 60 | 0. 19 |
| 309 | Travelers Cos Inc          | St Paul<br>Travelers 公司 | TRV UN  | 纽约交易所   | US | 573    | 231, 366. 87 | 0. 19 |
| 310 | Kraft Foods Inc A          | 卡夫食品公司                  | KFT UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 947    | 231, 321. 45 | 0. 19 |
| 311 | Allergan Inc               | 爱力根                     | AGN UN  | 纽约交易所   | US | 395    | 231, 270. 92 | 0. 19 |
| 312 | Moodys Corp                | 穆迪                      | MCO UN  | 纽约交易所   | US | 1, 000 | 231, 175. 10 | 0. 19 |
| 313 | Kroger Co                  | Kroger 公司               | KR UN   | 纽约交易所   | US | 1, 576 | 231, 158. 90 | 0. 19 |
| 314 | MeadWestvaco Corp          | MeadWestvaco 公司         | MWV UN  | 纽约交易所   | US | 1, 271 | 231, 119. 75 | 0. 19 |
| 315 | Sunoco Inc                 | 太阳石油                    | SUN UN  | 纽约交易所   | US | 769    | 231, 032. 78 | 0. 19 |
| 316 | Ameren Corp                | Ameren 公司               | AEE UN  | 纽约交易所   | US | 1, 089 | 231, 017. 35 | 0. 19 |
| 317 | Precision Castparts Corp   | Precision Castparts 公司  | PCP UN  | 纽约交易所   | US | 222    | 230, 964. 98 | 0. 19 |
| 318 | Newell Rubbermaid Inc      | 纽威尔                     | NWL UN  | 纽约交易所   | US | 2, 013 | 230, 958. 91 | 0. 19 |
| 319 | Whirlpool Corp             | 惠而浦                     | WHR UN  | 纽约交易所   | US | 597    | 230, 938. 04 | 0. 19 |
| 320 | Fossil Inc                 | 化石公司                    | FOSL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 477    | 230, 919. 44 | 0. 19 |
| 321 | Unitedhealth Group Inc     | 联合健康                    | UNH UN  | 纽约交易所   | US | 624    | 230, 884. 15 | 0. 19 |
| 322 | Marsh & McLennan Companies | Marsh & McLennan 公司     | MMC UN  | 纽约交易所   | US | 1, 132 | 230, 759. 93 | 0. 19 |
| 323 | Equity Residential         | 公寓物业权益信托                | EQR UN  | 纽约交易所   | US | 585    | 230, 736. 15 | 0. 19 |
| 324 | Hudson City Bancorp        | 哈得森城市银行                 | HCBK UQ | 纳斯达克交易所 | US | 5, 722 | 230, 537. 17 | 0. 19 |
| 325 | PACCAR Inc                 | 帕卡                      | PCAR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 929    | 230, 273. 86 | 0. 19 |
| 326 | Staples Inc                | Staples 公司              | SPLS UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2, 789 | 230, 203. 91 | 0. 19 |
| 327 | Iron Mountain Inc          | 美国铁山公司                  | IRM UN  | 纽约交易所   | US | 1, 104 | 230, 149. 45 | 0. 19 |
| 328 | Salesforce.com             | Salesforce 公司           | CRM UN  | 纽约交易所   | US | 263    | 229, 988. 42 | 0. 18 |
| 329 | Fastenal Co                | 快扣公司                    | FAST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 902    | 229, 970. 96 | 0. 18 |
| 330 | PG&E Corporation           | 太平洋煤气电力                 | PCG UN  | 纽约交易所   | US | 803    | 229, 921. 56 | 0. 18 |
| 331 | American Electric Power    | 美国电力                    | AEP UN  | 纽约交易所   | US | 911    | 229, 903. 16 | 0. 18 |
| 332 | Tyson Foods Inc A          | 泰森食品公司                  | TSN UN  | 纽约交易所   | US | 1, 930 | 229, 858. 88 | 0. 18 |
| 333 | Cooper Industries Plc      | 库珀工业公开有限公司              | CBE UN  | 纽约交易所   | US | 533    | 229, 846. 49 | 0. 18 |



|     |                              |                             |         |         |    |       |            |      |
|-----|------------------------------|-----------------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 334 | Urban Outfitters             | Urban Outfitters 公司         | URBN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,317 | 229,821.76 | 0.18 |
| 335 | Goldman Sachs Group Inc      | 高盛                          | GS UN   | 纽约交易所   | US | 379   | 229,789.56 | 0.18 |
| 336 | Pinnacle West Capital (AZ)   | Pinnacle 西部资本               | PNW UN  | 纽约交易所   | US | 702   | 229,729.73 | 0.18 |
| 337 | Edison Intl                  | 爱迪生国际                       | EIX UN  | 纽约交易所   | US | 786   | 229,677.36 | 0.18 |
| 338 | Southwest Airlines Co        | 西南航空                        | LUV UN  | 纽约交易所   | US | 3,937 | 229,588.43 | 0.18 |
| 339 | Honeywell Intl Inc           | 霍尼韦尔                        | HON UN  | 纽约交易所   | US | 650   | 229,568.57 | 0.18 |
| 340 | Goodrich Corp                | 古德里奇                        | GR UN   | 纽约交易所   | US | 286   | 229,552.13 | 0.18 |
| 341 | Cardinal Health Inc          | Cardinal Health 公司          | CAH UN  | 纽约交易所   | US | 864   | 229,517.97 | 0.18 |
| 342 | Apple Inc.                   | 苹果公司                        | AAPL UQ | 纳斯达克交易所 | US | 62    | 229,011.98 | 0.18 |
| 343 | Peoples United Financial Inc | Peoples United Financial 公司 | PBCT UQ | 纳斯达克交易所 | US | 3,118 | 228,961.25 | 0.18 |
| 344 | AT&T Inc                     | 美国电话电报集团                    | T UN    | 纽约交易所   | US | 1,015 | 228,929.12 | 0.18 |
| 345 | Waters Corp                  | 活德                          | WAT UN  | 纽约交易所   | US | 455   | 228,701.11 | 0.18 |
| 346 | Spectra Energy Corp          | 光谱能源公司                      | SE UN   | 纽约交易所   | US | 1,244 | 228,649.18 | 0.18 |
| 347 | CBRE Group, Inc.             | 世邦魏理仕                       | CBG UN  | 纽约交易所   | US | 2,209 | 228,577.08 | 0.18 |
| 348 | Mylan Inc.                   | 迈兰实验室                       | MYL UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,691 | 228,560.82 | 0.18 |
| 349 | DTE Energy Co                | DTE 能源                      | DTE UN  | 纽约交易所   | US | 609   | 228,531.10 | 0.18 |
| 350 | PPL Corp                     | PPL 公司                      | PPL UN  | 纽约交易所   | US | 1,299 | 228,488.21 | 0.18 |
| 351 | Ball Corp                    | 波尔                          | BLL UN  | 纽约交易所   | US | 880   | 228,480.69 | 0.18 |
| 352 | Leggett & Platt              | 礼恩派                         | LEG UN  | 纽约交易所   | US | 1,709 | 228,399.54 | 0.18 |
| 353 | Occidental Petroleum         | 西方石油                        | OXY UN  | 纽约交易所   | US | 421   | 228,386.89 | 0.18 |
| 354 | Progress Energy Inc          | Progress 能源                 | PGN UN  | 纽约交易所   | US | 600   | 228,341.54 | 0.18 |
| 355 | Smucker, J.M. Co             | JM 斯马克公司                    | SJM UN  | 纽约交易所   | US | 478   | 228,319.78 | 0.18 |
| 356 | Broadcom Corp A              | Broadcom 公司                 | BRCM UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,068 | 228,318.77 | 0.18 |
| 357 | Republic Services Inc        | 公共服务公司                      | RSG UN  | 纽约交易所   | US | 1,364 | 228,274.75 | 0.18 |
| 358 | Duke Energy Corp             | 杜克能源                        | DUK UN  | 纽约交易所   | US | 1,565 | 228,258.68 | 0.18 |
| 359 | AvalonBay Communities Inc    | AvalonBay 社区股份有限公司          | AVB UN  | 纽约交易所   | US | 255   | 228,185.95 | 0.18 |

|     |                             |                             |         |         |    |       |            |      |
|-----|-----------------------------|-----------------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 360 | Kohls Corp                  | Kohls 公司                    | KSS UN  | 纽约交易所   | US | 793   | 228,161.72 | 0.18 |
| 361 | Dollar Tree Inc             | Dollar Tree 公司              | DLTR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 670   | 227,987.35 | 0.18 |
| 362 | Schlumberger Ltd            | 斯伦贝谢                        | SLB UN  | 纽约交易所   | US | 555   | 227,854.84 | 0.18 |
| 363 | Applied Materials Inc       | 应用材料                        | AMAT UQ | 纳斯达克交易所 | US | 3,141 | 227,670.21 | 0.18 |
| 364 | Beam Inc                    | Beam 公司                     | BEAM UN | 纽约交易所   | US | 576   | 227,659.97 | 0.18 |
| 365 | Newfield Exploration Co     | 新田石油勘探公司                    | NFX UN  | 纽约交易所   | US | 1,228 | 227,650.10 | 0.18 |
| 366 | Starbucks Corp              | 星巴克                         | SBUX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 675   | 227,639.48 | 0.18 |
| 367 | Snap On Inc                 | Snap-On 公司                  | SNA UN  | 纽约交易所   | US | 578   | 227,573.06 | 0.18 |
| 368 | CMS Energy Corp             | CMS 能源                      | CMS UN  | 纽约交易所   | US | 1,531 | 227,560.41 | 0.18 |
| 369 | Symantec Corp               | 赛门铁克                        | SYMC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 2,462 | 227,505.51 | 0.18 |
| 370 | Consolidated Edison Inc     | 联合爱迪生                       | ED UN   | 纽约交易所   | US | 578   | 227,353.72 | 0.18 |
| 371 | Owens-Illinois Inc          | Owens-Illinois 公司           | OI UN   | 纽约交易所   | US | 1,875 | 227,340.62 | 0.18 |
| 372 | BMC Software Inc            | BMC 软件                      | BMC UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 842   | 227,295.15 | 0.18 |
| 373 | Carnival Corp               | 嘉年华公司                       | CCL UN  | 纽约交易所   | US | 1,048 | 227,158.53 | 0.18 |
| 374 | Dow Chemical                | 陶氏化学                        | DOW UN  | 纽约交易所   | US | 1,140 | 227,127.16 | 0.18 |
| 375 | Sealed Air Corp             | 希悦尔包装                       | SEE UN  | 纽约交易所   | US | 2,324 | 226,953.60 | 0.18 |
| 376 | Clorox Co                   | Clorox 公司                   | CLX UN  | 纽约交易所   | US | 495   | 226,859.62 | 0.18 |
| 377 | Xylem Inc                   | Xylem 公司                    | XYL UN  | 纽约交易所   | US | 1,425 | 226,856.77 | 0.18 |
| 378 | Cummins Inc                 | 康明斯                         | CMI UN  | 纽约交易所   | US | 370   | 226,790.04 | 0.18 |
| 379 | Thermo Fisher Scientific    | Thermo Fisher Scientific 公司 | TMO UN  | 纽约交易所   | US | 690   | 226,544.64 | 0.18 |
| 380 | Apartment Investment & Mgmt | 公寓投资与管理                     | AIV UN  | 纽约交易所   | US | 1,325 | 226,524.71 | 0.18 |
| 381 | Xcel Energy Inc             | Xcel 能源                     | XEL UN  | 纽约交易所   | US | 1,260 | 226,409.92 | 0.18 |
| 382 | Xilinx Inc                  | 赛灵思                         | XLNX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,066 | 226,340.47 | 0.18 |
| 383 | Tyco Intl                   | 泰科国际                        | TYC UN  | 纽约交易所   | US | 677   | 226,301.44 | 0.18 |
| 384 | Textron Inc                 | 德事隆                         | TXT UN  | 纽约交易所   | US | 1,438 | 226,197.78 | 0.18 |
| 385 | Bemis Co Inc                | Bemis 公司                    | BMS UN  | 纽约交易所   | US | 1,141 | 226,171.72 | 0.18 |
| 386 | Metropcs Communications Inc | MetroPCS 通信公司               | PCS UN  | 纽约交易所   | US | 5,908 | 226,073.43 | 0.18 |
| 387 | Franklin Resources Inc      | 富兰克林资源                      | BEN UN  | 纽约交易所   | US | 322   | 226,044.21 | 0.18 |

|     |                            |                       |         |         |    |       |            |      |
|-----|----------------------------|-----------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 388 | Safeway Inc                | Safeway 公司            | SWY UN  | 纽约交易所   | US | 1,969 | 226,035.17 | 0.18 |
| 389 | Viacom Inc B               | 维亚康姆公司                | VIAB UQ | 纳斯达克交易所 | US | 760   | 226,021.57 | 0.18 |
| 390 | General Dynamics           | 通用动力                  | GD UN   | 纽约交易所   | US | 541   | 225,700.01 | 0.18 |
| 391 | Emerson Electric Co        | 艾默生电气                 | EMR UN  | 纽约交易所   | US | 766   | 225,674.20 | 0.18 |
| 392 | Wynn Resorts Ltd           | 永利度假村有限公司             | WYNN UQ | 纳斯达克交易所 | US | 344   | 225,670.41 | 0.18 |
| 393 | Nordstrom Inc              | Nordstrom 公司          | JWN UN  | 纽约交易所   | US | 718   | 225,656.11 | 0.18 |
| 394 | Invesco Ltd                | 景顺有限公司                | IVZ UN  | 纽约交易所   | US | 1,578 | 225,563.64 | 0.18 |
| 395 | Corning Inc                | 康宁公司                  | GLW UN  | 纽约交易所   | US | 2,758 | 225,551.88 | 0.18 |
| 396 | Stanley Black & Decker     | 史丹利 Black & Decker 公司 | SWK UN  | 纽约交易所   | US | 554   | 225,517.09 | 0.18 |
| 397 | Pall Corp                  | Pall 公司               | PLL UN  | 纽约交易所   | US | 650   | 225,334.05 | 0.18 |
| 398 | Titanium Metals Corp       | 钛金属公司                 | TIE UN  | 纽约交易所   | US | 3,150 | 225,334.05 | 0.18 |
| 399 | Monster Beverage Corp      | 怪兽饮料公司                | MNST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 500   | 225,166.44 | 0.18 |
| 400 | McDonalds Corp             | 麦当劳                   | MCD UN  | 纽约交易所   | US | 402   | 225,097.25 | 0.18 |
| 401 | Roper Industries Inc       | Roper 工业股份有限公司        | ROP UN  | 纽约交易所   | US | 361   | 225,086.62 | 0.18 |
| 402 | Estee Lauder Cos.          | 雅诗兰黛                  | EL UN   | 纽约交易所   | US | 657   | 224,893.46 | 0.18 |
| 403 | Target Corp                | Target 百货             | TGT UN  | 纽约交易所   | US | 611   | 224,876.06 | 0.18 |
| 404 | Cigna Corporation          | CIGNA 公司              | CI UN   | 纽约交易所   | US | 807   | 224,584.55 | 0.18 |
| 405 | VF Corp                    | VF 公司                 | VFC UN  | 纽约交易所   | US | 266   | 224,519.40 | 0.18 |
| 406 | Nisource Inc               | NiSource 公司           | NI UN   | 纽约交易所   | US | 1,434 | 224,480.19 | 0.18 |
| 407 | Varian Medical Systems Inc | 瓦里安医疗设备有限公司           | VAR UN  | 纽约交易所   | US | 584   | 224,468.68 | 0.18 |
| 408 | Forest Laboratories        | 森林实验室                 | FRX UN  | 纽约交易所   | US | 1,014 | 224,406.57 | 0.18 |
| 409 | Coventry Health Care Inc   | Coventry 医疗保健公司       | CVH UN  | 纽约交易所   | US | 1,116 | 224,392.53 | 0.18 |
| 410 | Joy Global Inc             | 久益环球股份有限公司            | JOY UN  | 纽约交易所   | US | 625   | 224,257.24 | 0.18 |
| 411 | Devon Energy Corp          | 戴文能源                  | DVN UN  | 纽约交易所   | US | 611   | 224,103.16 | 0.18 |
| 412 | Genuine Parts Co           | 原配部件                  | GPC UN  | 纽约交易所   | US | 588   | 224,072.23 | 0.18 |
| 413 | Intl Paper Co              | 国际纸业                  | IP UN   | 纽约交易所   | US | 1,225 | 223,994.75 | 0.18 |
| 414 | Citigroup Inc              | 花旗集团                  | C UN    | 纽约交易所   | US | 1,292 | 223,988.24 | 0.18 |
| 415 | Harman Intl Industries Inc | 哈曼国际工业公司              | HAR UN  | 纽约交易所   | US | 894   | 223,916.64 | 0.18 |
| 416 | ConocoPhillips             | 康菲石油                  | COP UN  | 纽约交易所   | US | 633   | 223,724.62 | 0.18 |
| 417 | Equifax Inc                | Equifax 公司            | EFX UN  | 纽约交易所   | US | 758   | 223,413.18 | 0.18 |

|     |                            |                    |         |         |    |       |            |      |
|-----|----------------------------|--------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 418 | Rowan Cos Plc              | Rowan 公司           | RDC UN  | 纽约交易所   | US | 1,092 | 223,296.55 | 0.18 |
| 419 | Microchip Technology Inc   | Microchip 科技股份有限公司 | MCHP UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,067 | 223,245.95 | 0.18 |
| 420 | Schwab, Charles Corp       | 嘉信理财               | SCHW UN | 纽约交易所   | US | 2,729 | 223,180.23 | 0.18 |
| 421 | Airgas Inc                 | Airgas 股份有限公司      | ARG UN  | 纽约交易所   | US | 420   | 223,169.04 | 0.18 |
| 422 | Hess Corp                  | 阿美拉达赫斯             | HES UN  | 纽约交易所   | US | 812   | 223,151.33 | 0.18 |
| 423 | F5 Networks Inc            | F5 Networks 公司     | FFIV UQ | 纳斯达克交易所 | US | 354   | 222,916.29 | 0.18 |
| 424 | Diamond Offshore Drilling  | 钻石近海钻探公司           | DO UN   | 纽约交易所   | US | 596   | 222,898.84 | 0.18 |
| 425 | Interpublic Group Cos      | Interpublic 集团     | IPG UN  | 纽约交易所   | US | 3,248 | 222,894.54 | 0.18 |
| 426 | Advanced Micro Devices     | AMD 公司             | AMD UN  | 纽约交易所   | US | 6,148 | 222,813.83 | 0.18 |
| 427 | E*TRADE Financial Corp     | 亿创证券有限公司           | ETFC UQ | 纳斯达克交易所 | US | 4,380 | 222,732.62 | 0.18 |
| 428 | Southern Co                | 南方                 | SO UN   | 纽约交易所   | US | 760   | 222,560.58 | 0.18 |
| 429 | Caterpillar Inc            | 卡特彼勒               | CAT UN  | 纽约交易所   | US | 414   | 222,337.57 | 0.18 |
| 430 | Intl Flavors & Fragrances  | 国际香料               | IFF UN  | 纽约交易所   | US | 641   | 222,173.50 | 0.18 |
| 431 | National Oilwell Varco Inc | 美国国民油井             | NOV UN  | 纽约交易所   | US | 545   | 222,129.22 | 0.18 |
| 432 | Lam Research Corp          | Lam Research 公司    | LRCX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 930   | 221,992.61 | 0.18 |
| 433 | Juniper Networks Inc       | Juniper 公司         | JNPR UN | 纽约交易所   | US | 2,151 | 221,895.26 | 0.18 |
| 434 | LSI Corporation            | LSI 公司             | LSI UN  | 纽约交易所   | US | 5,505 | 221,794.32 | 0.18 |
| 435 | Procter & Gamble           | 宝洁                 | PG UN   | 纽约交易所   | US | 572   | 221,592.87 | 0.18 |
| 436 | FMC Technologies Inc       | FMC 技术公司           | FTI UN  | 纽约交易所   | US | 893   | 221,576.36 | 0.18 |
| 437 | Limited Brands Inc         | Limited Brands 公司  | LTD UN  | 纽约交易所   | US | 820   | 220,578.36 | 0.18 |
| 438 | Nucor Corp                 | 纽柯公司               | NUE UN  | 纽约交易所   | US | 919   | 220,296.90 | 0.18 |
| 439 | Tiffany & Co               | 蒂芙尼                | TIF UN  | 纽约交易所   | US | 657   | 220,031.57 | 0.18 |
| 440 | Walgreen Co                | 沃尔格林               | WAG UN  | 纽约交易所   | US | 1,172 | 219,270.12 | 0.18 |
| 441 | Unum Group                 | Unum 公司            | UNM UN  | 纽约交易所   | US | 1,812 | 219,243.55 | 0.18 |
| 442 | Alcoa Inc                  | 美国铝业               | AA UN   | 纽约交易所   | US | 3,961 | 219,213.13 | 0.18 |
| 443 | Grainger, W. W. Inc        | WW Grainger 公司     | GWW UN  | 纽约交易所   | US | 181   | 218,932.87 | 0.18 |
| 444 | GameStop Corp A            | GameStop 公司        | GME UN  | 纽约交易所   | US | 1,885 | 218,895.93 | 0.18 |
| 445 | Ralph Lauren Corp          | Ralph Lauren 公     | RL UN   | 纽约交易所   | US | 247   | 218,808.78 | 0.18 |

|     |                              | 司                    |         |         |    |       |            |      |
|-----|------------------------------|----------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 446 | United Technologies Corp     | 联合技术                 | UTX UN  | 纽约交易所   | US | 458   | 218,795.62 | 0.18 |
| 447 | Air Products & Chemicals Inc | 空气化工产品               | APD UN  | 纽约交易所   | US | 428   | 218,540.73 | 0.18 |
| 448 | Borgwarner Inc               | 博格华纳股份有限公司           | BWA UN  | 纽约交易所   | US | 526   | 218,211.20 | 0.18 |
| 449 | Ross Stores Inc              | Ross 商店有限公司          | ROST UQ | 纳斯达克交易所 | US | 552   | 218,104.31 | 0.18 |
| 450 | Eaton Corp                   | 伊顿                   | ETN UN  | 纽约交易所   | US | 870   | 218,070.53 | 0.18 |
| 451 | Progressive Corp             | Progressive 公司       | PGR UN  | 纽约交易所   | US | 1,654 | 217,910.64 | 0.18 |
| 452 | Noble Energy Inc             | Noble 能源股份有限公司       | NBL UN  | 纽约交易所   | US | 406   | 217,810.08 | 0.18 |
| 453 | EOG Resources                | EOG 资源               | EOG UN  | 纽约交易所   | US | 382   | 217,715.83 | 0.18 |
| 454 | TE Connectivity Ltd.         | 泰科电子公司               | TEL UN  | 纽约交易所   | US | 1,077 | 217,368.28 | 0.17 |
| 455 | AutoNation Inc               | AutoNation 公司        | AN UN   | 纽约交易所   | US | 973   | 217,117.63 | 0.17 |
| 456 | Helmerich & Payne Inc        | Helmerich & Payne 公司 | HP UN   | 纽约交易所   | US | 788   | 216,705.24 | 0.17 |
| 457 | Agilent Technologies Inc     | 安捷伦                  | A UN    | 纽约交易所   | US | 872   | 216,420.87 | 0.17 |
| 458 | Illinois Tool Works Inc      | 伊利诺伊工具               | ITW UN  | 纽约交易所   | US | 646   | 216,102.48 | 0.17 |
| 459 | AutoZone Inc                 | AutoZone 公司          | AZO UN  | 纽约交易所   | US | 93    | 215,975.16 | 0.17 |
| 460 | Altera Corp                  | Altera 公司            | ALTR UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,008 | 215,746.89 | 0.17 |
| 461 | Humana Inc                   | Humana 公司            | HUM UN  | 纽约交易所   | US | 440   | 215,512.11 | 0.17 |
| 462 | Molex Inc                    | Molex 公司             | MOLX UQ | 纳斯达克交易所 | US | 1,423 | 215,467.96 | 0.17 |
| 463 | 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 | 582   | 215,454.30 | 0.17 |
| 464 | Texas Instruments Inc        | 德州仪器                 | TXN UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 1,187 | 215,394.66 | 0.17 |
| 465 | Computer Sciences            | 电脑系统咨询               | CSC UN  | 纽约交易所   | US | 1,372 | 215,382.07 | 0.17 |
| 466 | Harley-Davidson Inc          | 哈雷摩托车                | HOG UN  | 纽约交易所   | US | 744   | 215,192.83 | 0.17 |
| 467 | Mead Johnson Nutrition Co    | 美赞臣营养品公司             | MJN UN  | 纽约交易所   | US | 422   | 214,889.87 | 0.17 |
| 468 | Alpha Natural                | 阿尔法自然资               | ANR UN  | 纽约交易所   | US | 3,899 | 214,795.44 | 0.17 |

|     | Resources                        | 源股份有限公<br>司                     |         |             |    |       |            |      |
|-----|----------------------------------|---------------------------------|---------|-------------|----|-------|------------|------|
| 469 | Rockwell Automation Inc          | 罗克韦尔自动<br>化                     | ROK UN  | 纽约交易所       | US | 513   | 214,343.14 | 0.17 |
| 470 | Freeport McMoRan Copper & Gold   | 自由港迈克墨<br>伦                     | FCX UN  | 纽约交易所       | US | 994   | 214,196.41 | 0.17 |
| 471 | Parker-Hannifin Corp             | 派克汉尼汾                           | PH UN   | 纽约交易所       | US | 440   | 213,953.66 | 0.17 |
| 472 | QUALCOMM Inc                     | 高通公司                            | QCOM UQ | 纳斯达克交<br>易所 | US | 607   | 213,767.45 | 0.17 |
| 473 | Teradyne Inc                     | 泰瑞达                             | TER UN  | 纽约交易所       | US | 2,397 | 213,160.64 | 0.17 |
| 474 | Penney, J. C. Inc                | 彭尼公司                            | JCP UN  | 纽约交易所       | US | 1,443 | 212,746.42 | 0.17 |
| 475 | Archer-Daniels-M<br>idland Co    | ADM 公司                          | ADM UN  | 纽约交易所       | US | 1,137 | 212,290.46 | 0.17 |
| 476 | FLIR Systems Inc                 | FLIR 系统公司                       | FLIR UQ | 纳斯达克交<br>易所 | US | 1,718 | 211,890.47 | 0.17 |
| 477 | Expeditors Intl<br>of WA Inc     | 华盛顿康捷国<br>际物流公司                 | EXPD UQ | 纳斯达克交<br>易所 | US | 864   | 211,757.65 | 0.17 |
| 478 | Chipotle Mexican<br>Grill Inc.   | Chipotle<br>Mexican Grill<br>股份 | CMG UN  | 纽约交易所       | US | 88    | 211,476.83 | 0.17 |
| 479 | Cameron<br>International<br>Corp | 卡梅隆国际公<br>司                     | CAM UN  | 纽约交易所       | US | 780   | 210,706.45 | 0.17 |
| 480 | Electronic Arts                  | 电子艺界                            | EA UQ   | 纳斯达克交<br>易所 | US | 2,697 | 210,669.45 | 0.17 |
| 481 | Johnson Controls<br>Inc          | 江森自控                            | JCI UN  | 纽约交易所       | US | 1,202 | 210,666.10 | 0.17 |
| 482 | Macys Inc                        | 联合百货                            | M UN    | 纽约交易所       | US | 966   | 209,873.46 | 0.17 |
| 483 | BlackRock Inc                    | 贝莱德有限公<br>司                     | BLK UN  | 纽约交易所       | US | 195   | 209,448.43 | 0.17 |
| 484 | Celgene Corp                     | Celgene 公司                      | CELG UQ | 纳斯达克交<br>易所 | US | 516   | 209,395.68 | 0.17 |
| 485 | Carmax Inc                       | CarMax 公司                       | KMX UN  | 纽约交易所       | US | 1,274 | 209,022.51 | 0.17 |
| 486 | WellPoint Inc                    | WellPoint 公司                    | WLP UN  | 纽约交易所       | US | 518   | 208,995.06 | 0.17 |
| 487 | Family Dollar<br>Stores Inc      | 家庭美元商店                          | FDO UN  | 纽约交易所       | US | 497   | 208,978.24 | 0.17 |
| 488 | Dover Corp                       | 多佛                              | DOV UN  | 纽约交易所       | US | 615   | 208,532.90 | 0.17 |
| 489 | Rockwell Collins                 | 罗克威尔克林<br>斯                     | COL UN  | 纽约交易所       | US | 667   | 208,193.25 | 0.17 |
| 490 | Coach Inc                        | Coach 公司                        | COH UN  | 纽约交易所       | US | 560   | 207,132.89 | 0.17 |
| 491 | Newmont Mining<br>Corp           | 纽蒙特矿业                           | NEM UN  | 纽约交易所       | US | 673   | 206,490.47 | 0.17 |

|     |                           |                    |         |         |    |       |            |      |
|-----|---------------------------|--------------------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| 492 | Ford Motor Co             | 福特汽车               | F UN    | 纽约交易所   | US | 3,365 | 204,106.74 | 0.16 |
| 493 | Hewlett-Packard Co        | 惠普                 | HPQ UN  | 纽约交易所   | US | 1,585 | 201,602.08 | 0.16 |
| 494 | Aetna Inc                 | 安泰保险               | AET UN  | 纽约交易所   | US | 818   | 200,586.99 | 0.16 |
| 495 | Pioneer Natural Resources | Pioneer 自然资源公司     | PXD UN  | 纽约交易所   | US | 357   | 199,177.24 | 0.16 |
| 496 | Bed Bath & Beyond Inc     | Bed Bath&Beyond 公司 | BBBY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 503   | 196,612.05 | 0.16 |
| 497 | OReilly Automotive        | OReilly 汽车股份有限公司   | ORLY UQ | 纳斯达克交易所 | US | 368   | 194,979.97 | 0.16 |
| 498 | NIKE Inc B                | 耐克公司               | NKE UN  | 纽约交易所   | US | 348   | 193,209.50 | 0.16 |
| 499 | Ryder System Inc          | Ryder 系统           | R UN    | 纽约交易所   | US | 836   | 190,407.07 | 0.15 |
| 500 | Western Digital Corp      | 西部数据公司             | WDC UQ  | 纳斯达克交易所 | US | 963   | 185,649.98 | 0.15 |

## 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  | Fossil Inc                   | FOSL UQ | 313,282.67 | 0.24           |
| 2  | WPX Energy Inc.              | WPX UN  | 274,059.99 | 0.21           |
| 3  | Crown Castle Intl Corp       | CCI UN  | 265,235.27 | 0.20           |
| 4  | Phillips 66                  | PSX UN  | 231,867.09 | 0.17           |
| 5  | Alexion Pharmaceuticals Inc  | ALXN UQ | 229,242.08 | 0.17           |
| 6  | Exelon Corp                  | EXC UN  | 224,175.79 | 0.17           |
| 7  | Monster Beverage Corp        | MNST UQ | 215,806.49 | 0.16           |
| 8  | First Solar Inc              | FSLR UQ | 211,423.67 | 0.16           |
| 9  | Lam Research Corp            | LRCX UQ | 184,706.05 | 0.14           |
| 10 | Alpha Natural Resources      | ANR UN  | 166,058.62 | 0.13           |
| 11 | Kinder Morgan Inc            | KMI UN  | 156,436.69 | 0.12           |
| 12 | Express Scripts Holding Co.  | ESRX UQ | 117,744.54 | 0.09           |
| 13 | NetFlix Inc                  | NFLX UQ | 106,109.59 | 0.08           |
| 14 | Allegheny Technologies Inc   | ATI UN  | 105,040.60 | 0.08           |
| 15 | Apollo Group Inc             | APOL UQ | 104,064.88 | 0.08           |
| 16 | Electronic Arts              | EA UQ   | 101,168.08 | 0.08           |
| 17 | GENWORTH FINANCIAL INC       | GNW UN  | 98,163.18  | 0.07           |
| 18 | FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | FTR UQ  | 93,765.44  | 0.07           |
| 19 | PEABODY ENERGY CORP          | BTU UN  | 93,201.17  | 0.07           |
| 20 | SEARS HLDGS CORP             | SHLD UQ | 89,074.14  | 0.07           |



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  | MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC      | MHS UN  | 281,083.00 | 0.21            |
| 2  | Sara Lee Corp                   | SLE UN  | 269,033.32 | 0.20            |
| 3  | Motorola Mobility Holdings, Inc | MMI UN  | 267,272.33 | 0.20            |
| 4  | Supervalu Inc                   | SVU UN  | 259,808.53 | 0.20            |
| 5  | Express Scripts Holding Co.     | ESRX UQ | 249,307.49 | 0.19            |
| 6  | NOVELLUS SYSTEMS INC            | NVLS UQ | 242,907.85 | 0.18            |
| 7  | CONSTELLATION ENERGY GROUP INC  | CEG UN  | 239,753.07 | 0.18            |
| 8  | EL PASO CORP                    | EP UN   | 221,832.71 | 0.17            |
| 9  | Expedia                         | EXPE UQ | 213,962.08 | 0.16            |
| 10 | Exelon Corp                     | EXC UN  | 197,280.58 | 0.15            |
| 11 | Sears Holdings Corp             | SHLD UQ | 191,994.18 | 0.14            |
| 12 | Regions Financial Corp          | RF UN   | 177,879.03 | 0.13            |
| 13 | Pulte Group Inc                 | PHM UN  | 176,546.06 | 0.13            |
| 14 | SUNOCO INC                      | SUN UN  | 173,836.00 | 0.13            |
| 15 | Bank of America Corp            | BAC UN  | 158,738.80 | 0.12            |
| 16 | NetFlix Inc                     | NFLX UQ | 156,575.92 | 0.12            |
| 17 | Whirlpool Corp                  | WHR UN  | 150,807.48 | 0.11            |
| 18 | Sherwin-Williams Co             | SHW UN  | 150,422.25 | 0.11            |
| 19 | Masco Corp                      | MAS UN  | 149,003.98 | 0.11            |
| 20 | LSI Corporation                 | LSI UN  | 148,056.47 | 0.11            |

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 12,288,375.30 |
| 卖出收入（成交）总额 | 30,553,752.88 |

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 146,186.21 |
| 4  | 应收利息    | 213.34     |
| 5  | 应收申购款   | 49,489.77  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 195,889.32 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 5,962        | 22,048.38     | 1,703,710.95 | 1.30%      | 129,748,733.97 | 98.70%     |

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 |
|-------------------|-----------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 44,468.40 | 0.03%    |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：0  
2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 150,455,310.00 |
| 本报告期基金总申购份额   | 27,688,859.66  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 46,691,724.74  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 131,452,444.92 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|-------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|       |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 摩根士丹利 | 1      | 12,128,963.61 | 28.31%       | 3,643.84  | 25.83%     | -  |
| 高盛证券  | 1      | 11,297,876.82 | 26.37%       | 3,400.39  | 24.11%     | -  |
| 野村证券  | 1      | 10,684,978.75 | 24.94%       | 3,219.63  | 22.82%     | -  |
| 美林证券  | 1      | 8,102,378.93  | 18.91%       | 3,653.52  | 25.90%     | -  |
| 花旗银行  | 1      | 627,930.07    | 1.47%        | 189.11    | 1.34%      | -  |

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

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

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

（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

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

- （一）具备该机构所在国家或地区政府、监管机构核发的营业执照、业务许可证明文件；
- （二）资历雄厚，信誉良好；
- （三）财务状况良好，经营行为规范；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度（包括但不限于公平交易制度及保密制度），能满足各投资组合运作高度保密的要求；

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

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

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

（八）能提供各投资组合运作、管理所需的其他服务。

（九）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

交易管理部在每季初 5 个工作日内，汇总上季度境外券商综合服务评价结果，作为本季度境外券商交易量分配依据。并依此制作交易量分配计划，报部门及公司分管领导批准；

交易量分配计划获批后，作为选择交易券商的依据，交交易员在交易时进行券商选择。

公司通过一家境外券商买卖证券的年交易佣金，不得超过公司当年所有境外投资组合通过境外券商买卖证券交易佣金的 30%。

券商服务出现重大失误或其他异常情况时，及时报公司监察稽核部及相关领导。可暂停与该券商的合作，并对其失误所造成的损失进行追偿。

3、境内交易单元包括：长江证券、中信证券、海通证券、光大证券、江海证券、安信证券、东方证券、中金公司、广州证券、中投证券、湘财证券、银河证券、招商证券、光大证券、申银万国、华泰联合证券、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。上述交易单元无交易。

4、本报告期内本基金退租的境内交易单元：中邮证券，新增境内交易单元：广发证券、西南证券。境外交易单元无变化。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式          | 法定披露日期    |
|----|--|-----------------|-----------|
| 1  | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-1-12 |
| 2  | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年第 4 季度报告          | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-1-20 |
| 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 | 2012-2-16 |
| 4  | 大成标普 500 等权重指数基金                             | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-2-23 |
| 5  | 关于旗下部分基金增加中信证券(浙江)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 | 2012-2-23 |
| 6  | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年年度报告              | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-3-28 |
| 7  | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要            | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-3-28 |
| 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 | 2012-3-30 |
| 9  | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2012 年第 1 季度报告          | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-4-21 |
| 10 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新的招募说明书                 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-5-9  |
| 11 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新                       | 中国证监会指定报刊及本     | 2012-5-9  |

|    |  |                 |           |
|----|--|-----------------|-----------|
|    | 的招募说明书摘要                                     | 公司网站            |           |
| 12 | 关于旗下部分基金增加信达证券股份有限公司为代销机构的公告                 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-5-9  |
| 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 | 2012-5-23 |
| 14 | 关于赎回公司持有旗下部分开放式基金的公告                         | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-6-8  |
| 15 | 大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 中国证监会指定报刊及本公司网站 | 2012-6-29 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 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  
2012 年 8 月 25 日