

博时标普 500 指数型证券投资基金

2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2013 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2012 年 6 月 14 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	4
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
§ 7 年度财务报表	134
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
7.4 报表附注	17
§ 8 投资组合报告	32
8.1 期末基金资产组合情况	32
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	33
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	34
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	64
8.7 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	64
8.8 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	65

8.9 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.....	65
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	65
8.11 投资组合报告附注.....	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	66
§ 10 开放式基金份额变动.....	66
§ 11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	67
§ 12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时标普 500 指数型证券投资基金
基金简称	博时标普 500 指数 (QDII)
基金主代码	050025
交易代码	050025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 14 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,564,684.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%。其余部分将主要投资于固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具。</p> <p>本基金的股票资产主要采取完全复制法，即完全按照标的指数成份股的构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应地调整。</p>
业绩比较基准	标普500净总收益指数 (S&P 500 Index (Net TR)) 收益率
风险收益特征	属于高风险/高收益特征的开放式基金

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		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		杨鹤	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon

	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York, NY 10286
办公地址		-	One Wall Street New York, NY 10286
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	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
本期已实现收益	2,065,130.82
本期利润	3,247,370.46
加权平均基金份额本期利润	0.0303
本期加权平均净值利润率	3.00%
本期基金份额净值增长率	4.29%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配利润	590,280.25
期末可供分配基金份额利润	0.0097
期末基金资产净值	61,523,279.04
期末基金份额净值	1.0158
3.1.3 累计期末指标	2012年末
基金份额累计净值增长率	4.29%

注：本基金合同于 2012 年 6 月 14 日生效，基金合同生效日起至报告期末不满一年。

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。

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

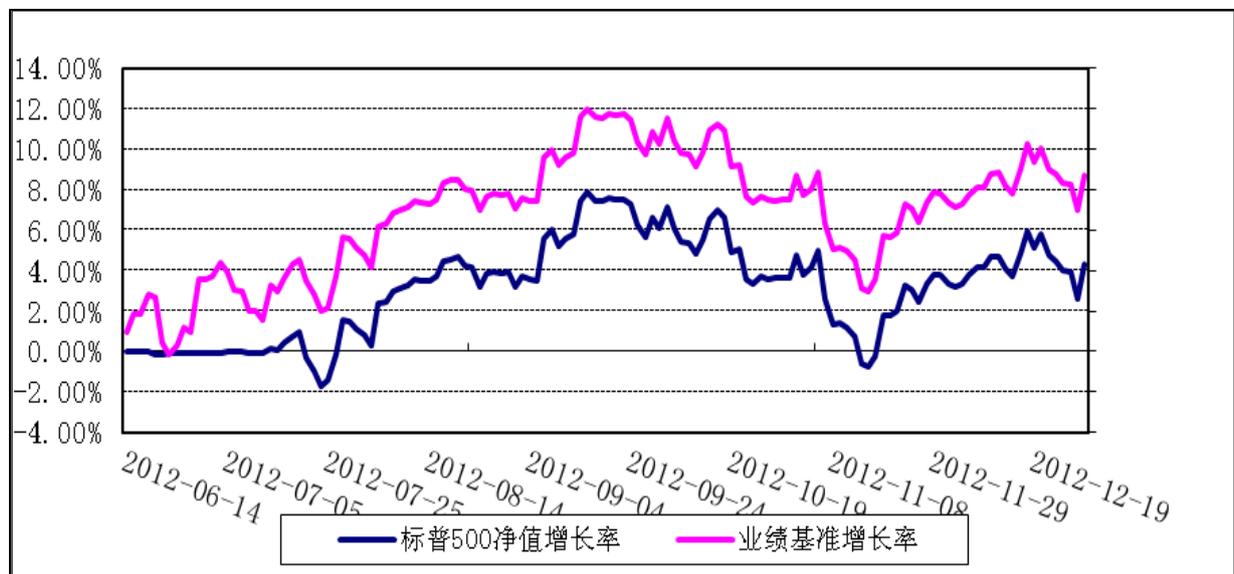
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.67%	0.81%	-1.44%	0.82%	-0.23%	-0.01%
过去六个月	4.34%	0.73%	4.92%	0.77%	-0.58%	-0.04%
过去一年	4.29%	0.70%	8.70%	0.81%	-4.41%	-0.11%
自基金合同生效起至今	4.29%	0.70%	8.70%	0.81%	-4.41%	-0.11%

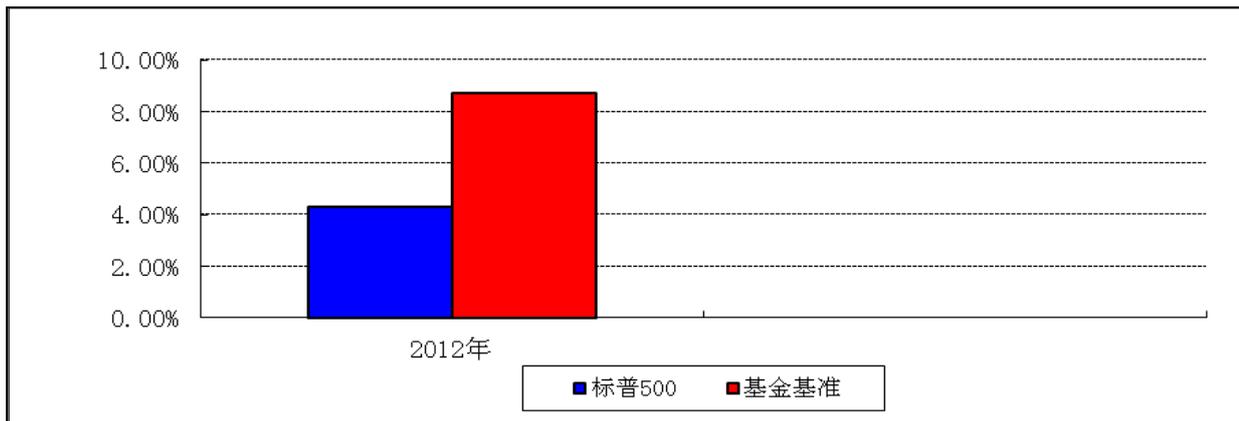
注：本基金的业绩比较基准为：标普 500 净总收益指数（S&P 500 Index (Net TR)）收益率

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：本基金的基金合同于2012年6月14日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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



注：本基金2012年实际运作期间为2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	0.280	740,115.09	374,239.07	1,114,354.16	-
合计	0.280	740,115.09	374,239.07	1,114,354.16	-

§ 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

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26号文批准设立。总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；璟安股权投资有限公司，持有股份 6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；上海丰益股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2012 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理三十三只开放式基金和二只封闭式基金，并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分全国社保基金，以及多个企业年金账户、特定资产管理账户。截至 2012 年 12 月 31 日，博时管理的公募基金资产规模逾 1371 亿元人民币，累计分红超过 579 亿元人民币。博时基金公司是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，2012 年，博时旗下共有 8 只基金的年度收益位居同类型基金前 1/3。

开放式股票型基金中，截至 2012 年 12 月 31 日，博时主题行业基金的年度收益在同类型 274 只股票型产品中排名第 16，此外，博时创业成长基金、博时卓越品牌基金、博时第三产业基金的年度收益均位于同类型 274 只标准股票型基金的前 1/3；债券型基金中，博时信用债券基金的年度收益在同类型 55 只产品中排名第 9；货币基金中，博时现金收益基金的年度收益在同类 49 只基金中排名第 2；

封闭式基金中，截至 2012 年 12 月 31 日，博时裕隆封闭的年度收益在同类的 25 只基金中排名第 2；

QDII 基金中，截至 2012 年 12 月 28 日，博时大中华亚太精选股票基金的年度收益在全部 6 只 QDII 亚太型股票基金产品中排名第 1。

2、客户服务

2012 年全年，博时基金共举办各类渠道培训活动共计 663 场；“博时 e 视界”共举办视频直播活动 27 场，在线人数累计 2581 人次；

2012 年 1 月 5 日举办“2012 博时基金投资策略媒体交流会”，到会 50 多家媒体。1 月 6 日在中华世纪坛举办“博时基金投资论坛暨 2012 投资策略交流会”，到会约 220 名机构和零售高端客户，通过这些活动，博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题，受到了投资者的广泛欢迎。

3、品牌获奖

2012 年 3 月 26 日，在“证券时报 2011 年度中国基金业明星奖”中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得“2011 年度十大明星基金公司奖”、博时特许价值股票基金获得“三年持续回报股票型明星基金奖”、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得“2011 年度股票型明星基金奖”、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得“2011 年度平衡混合型明星基金奖”、博时裕隆封闭获得“2011 年度封闭式明星基金奖”。

2012 年 3 月 28 日，中证报“2012 年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典”在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭荣获“五年期封闭式金牛基金”、博时主题行业荣获“五年期股票型金牛基金”、博时第三产业荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时特许价值荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时价值增长荣获“2011 年度混合型金牛基金”。

2012 年 4 月 20 日，由上海证券报社主办的第九届中国“金基金”奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得 2011 年度“金基金·TOP 公司奖”，博时主题行业股票基金获得 2011 年度“五年期金基金·股票型基金奖”，博时价值增长混合基金获得 2011 年度“一年期金基金·偏股混合型基金奖”。

2012 年 5 月 25 日，在由 21 世纪经济报道主办的“2011 年度赢基金奖”评选中，博时基金荣获“2011 年度中国最佳基金公司”奖项。

6 月 28 日，世界品牌实验室(WBL)在京发布 2012 年(第九届)《中国 500 最具价值品牌》排行榜，博时基金以 61.92 亿元的品牌价值位列第 220 名，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

2012 年 12 月 12 日，在经济观察报“2011-2012 年度中国卓越金融奖”评选活动中，博时基金凭借出色的线上服务水平和便利的电子交易平台，荣获“年度卓越基金公司电子服务奖”，成为唯一获此殊荣的基金公司。

2012 年 12 月 14 日，东方财富风云榜颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获“2012 年度最佳企业年金投资管理人”奖项。

4、其他大事件

博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2 月 29 日正式成立。

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于 2012 年 3 月 5 日至 3 月 30 日完成了首次募集。

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金于 5 月 11 日起在上交所上市，交易代码为 510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

博时于 5 月 15 日开通支付宝支付渠道，成为首家在直销网上交易中引入支付宝渠道的基金公司。

博时标普 500 指数型证券投资基金首募顺利结束并于 6 月 14 日正式成立。

博时医疗保健行业股票型证券投资基金首募顺利结束并于 8 月 28 日正式成立。

博时信用债纯债债券型证券投资基金首募顺利结束并于 9 月 7 日正式成立。

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金首募顺利结束并于 12 月 6 日正式成立。

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		
王政	ETF 及量化投资组投资总监 / 基金经理	2012-6-14	2012-11-13	13	1995 年至 1997 年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997 年 8 月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州彭博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009 年 5 月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部总经理、ETF 及量化投资组投资总监、博时上证超大盘 ETF 及联接基金基金经理、博时深证基本面 200ETF 及联接基金基金经理、博时标准普尔指数基金的基金经理。
胡俊敏	基金经理	2012-11-13	—	6	胡俊敏女士，博士。1996 年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、汤姆森金融公司、贝莱德全球金融公司工作，2011 年 2 月加入博时基金管理有限公司，现任博时特许价值基金、博时上证自然资源 ETF 基金及其联接基金、博时

					沪深 300 指数基金、博时标普 500 指数基金的基金经理。
赵云阳	量化分析师 / 基金经理助理	2012-6-14	2012-11-13	2	2003 年起在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时，历任股票投资部 ETF 量化分析组量化分析师兼任博时深证基本面 200ETF 基金、博时深证基本面 200ETF 基金联接基金、博时标普 500 指数基金的基金经理助理。现任博时深证基本面 200ETF 基金及其联接基金基金经理。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

博时基金管理有限公司于2013年1月12日发布公告称，聘请王红欣先生担任博时标普500指数型证券投资基金的基金经理，与胡俊敏共同管理博时标普500指数型证券投资基金。

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

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的《公平交易管理制度》的规定，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 年是美国经济逐步复苏的一年，美国股市表现相对好于其他市场。一季度美国的宏观经济持续走强，相关数据好于预期，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。相比而言，欧洲债务危机虽然有所缓解，但欧洲诸国经济依然较差；二季度欧洲债务危机进一步恶化，欧洲经济出现了加速萎缩的局面，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，但美国实体经济各部门的资产负债结构比较健康，并未出现经济衰退的征兆。三季度美国宏观经济明显好转，经济数据继续支持复苏的趋势。四季度美国大选、飓风桑迪、财政悬崖问题引起市场波动，随着相关政策的明确，美国经济走势逐步明朗，经济增长动力在持续增强。

本基金成立于 2012 年 6 月 14 日，成立后逐步建仓，股票资产主要采取完全复制法，完全按照标的指数成份股的构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应地调整。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金用少量资产投资标的指数股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0158 元，份额累计净值为 1.0438 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 4.29%，同期业绩基准增长率为 8.70%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年，欧债危机和美国财政政策仍然具有很大的不确定性，但趋势或将好于 2012 年。欧洲方面，欧债危机进一步加剧的可能性较小，最坏的时期已经过去。2013 年美国经济依然会缓慢增长，通胀率或将持续保持在低位，货币政策依然保持宽松。美国财政紧缩以及增加税收的政策，或将对消费和 GDP 的增长带来负面影响，但资本支出的改善和房地产的持续走强应该会令经济能够应付年初时的疲软，下半年经济增长有望加速至趋势水平。

在投资策略上，本基金为被动型指数基金，我们将会以最小跟踪误差为目标，紧密跟踪标普 500 净总收益指数（S&P 500 Index (Net TR)），为投资者分享美国发达市场的投资收益。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2012 年，我公司根据法律、法规的规定，更新了《基金投资管理制度》、《博时基金公募产品开发管理流程手册》、《员工投资基金管理制度》、《博时基金股指期货投资管理流程手册》、《债券池管理办法》、《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。根据新业务发展情况制定了《博时基金管理公司内幕交易防控制度》、《博时基

金管理有限公司产品委员会制度》、《境外券商选择和佣金分配管理办法》等制度和手册，不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；每一基金份额享有同等分配权；基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

本基金管理人已于 2012 年 9 月 18 日发布了分红公告，以截止到 2012 年 9 月 13 日的可供分配利润为基准，基金份额持有人每 10 份基金份额派发红利 0.28 元。

§ 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

2012 年，本基金托管人在对博时标普 500 指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年，博时标普 500 指数型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普 500 指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时标普 500 指数型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 1,114,354.16 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普 500 指数型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

博时标普 500 指数型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时标普 500 指数型证券投资基金(以下简称“博时标普 500 指数基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是博时标普 500 指数基金的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述博时标普 500 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时标普 500 指数基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
 会计师事务所有限公司

注册会计师

汪 棣

中国·上海市

注册会计师

金 毅

2013 年 3 月 21 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 指数型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	4,153,381.20
结算备付金		412,639.93
存出保证金		219,992.50
交易性金融资产	7.4.7.2	57,100,458.21
其中：股票投资		57,100,458.21
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	763.11
应收股利		60,797.95
应收申购款		554,458.14

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		62,502,491.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		510,374.65
应付管理人报酬		56,902.72
应付托管费		14,225.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	397,708.97
负债合计		979,212.00
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	60,564,684.16
未分配利润	7.4.7.10	958,594.88
所有者权益合计		61,523,279.04
负债和所有者权益总计		62,502,491.04

注：1. 报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.0158元，基金份额总额60,564,684.16份。2. 本财务报表的实际编制期间为2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：博时标普 500 指数型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至2012 年12月31日
一、收入		4,546,604.08
1. 利息收入		886,278.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	88,847.06
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		797,431.17
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,232,496.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,808,988.74
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-163,972.13
股利收益	7.4.7.15	587,480.28
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,182,239.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-166,712.94
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	412,302.26
减：二、费用		1,299,233.62
1. 管理人报酬		567,591.91
2. 托管费		141,897.98
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	90,030.88
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	499,712.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,247,370.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,247,370.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时标普 500 指数型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	310,182,625.61	-	310,182,625.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,247,370.46	3,247,370.46
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）	-249,617,941.45	-1,174,421.42	-250,792,362.87
其中：1. 基金申购款	77,364,414.66	1,684,955.04	79,049,369.70
2. 基金赎回款	-326,982,356.11	-2,859,376.46	-329,841,732.57
四、本期向基金份额持有人分配	-	-1,114,354.16	-1,114,354.16

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)	60,564,684.16	958,594.88	61,523,279.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：何宝

主管会计工作的负责人：王德英

会计机构负责人：成江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时标普 500 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]284 号《关于核准博时标普 500 指数型证券投资基金募集的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 310,166,385.64 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 227 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 310,182,625.61 份基金份额,其中认购资金利息折合 16,239.97 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为纽约梅隆银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标普 500 净总收益指数成份股和备选成份股,及全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具,包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证,公募基金,权证、期权、期货等金融衍生产品,结构性投资产品,银行存款、回购协议、短期政府债券等货币市场工具,政府债券(短期政府债券除外)、公司债券、可转换债券等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。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:标普 500 净总收益指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2013 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的

中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的, 予以终止确认: (1) 收取该金融资产现金流量的合同权

利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利及基金分红收益扣除股票和基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息

收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2012年12月31日
活期存款	4,153,381.20
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,153,381.20

注：于2012年12月31日，银行存款中包含的外币余额为美元118,459.42元(折合人民币744,576.69元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,909,418.87	57,100,458.21	1,191,039.34
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	55,909,418.87	57,100,458.21	1,191,039.34
----	---------------	---------------	--------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注 (投资成本)
		资产	负债	
利率衍生工具				
一无	-	-	-	-
货币衍生工具				
一外汇期货	-	-	-	-
权益衍生工具				
一股股指期货	4,475,687.46	-	-	-
一指数期权	-	-	-	-
一股票期权	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,475,687.46	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESH3	S&P500 EMINI FUT Mar13	10	4,463,019.28	-8,799.70
减：可抵销期货暂收款				-8,799.70
股指期货投资净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应收活期存款利息	763.11
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	-
合计	763.11

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付指数使用费	295,785.57
预提费用	100,000.00
应付赎回费	1,923.40
合计	397,708.97

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	310,182,625.61	310,182,625.61
本期申购	77,364,414.66	77,364,414.66
本期赎回（以“-”号填列）	-326,982,356.11	-326,982,356.11
本期末	60,564,684.16	60,564,684.16

注：

1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自2012年5月15日至2012年6月12日止期间公开发售，共募集有效净认购资金(含利息折份额) 310,182,625.61元。根据《博时标普500指数型证券投资基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入16,239.97元，连同有效认购资金一同折算为基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《博时标普500指数型证券投资基金基金合同》和《博时标普500指数型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2012年6月14日(基金合同生效日)至2012年7月15日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购业务、赎回业务和转换业务自2012年7月16日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,065,130.82	1,182,239.64	3,247,370.46
本期基金份额交易产生	-360,496.41	-813,925.01	-1,174,421.42

的变动数			
其中：基金申购款	719,447.90	965,507.14	1,684,955.04
基金赎回款	-1,079,944.31	-1,779,432.15	-2,859,376.46
本期已分配利润	-1,114,354.16	-	-1,114,354.16
本期末	590,280.25	368,314.63	958,594.88

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
活期存款利息收入	88,584.34
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	262.72
合计	88,847.06

7.4.7.12 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6月14日（基金合同生效日）至 2012年12月31日止期间
卖出股票成交总额	54,772,435.97
减：卖出股票成本总额	52,963,447.23
买卖股票差价收入	1,808,988.74

7.4.7.13 债券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至 2012年12月31日止期间
远期投资收益	-
期货投资收益	-163,972.13
期权投资收益	-
合计	-163,972.13

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	587,480.28

基金投资产生的股利收益	-
合计	587,480.28

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	1,191,039.34
——股票投资	1,191,039.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-8,799.70
——期货投资	-8,799.70
3. 其他	-
合计	1,182,239.64

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
基金赎回费收入	412,231.49
基金转出费收入	70.77
合计	412,302.26

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费的25%归基金资产。
2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日
交易所市场交易费用	90,030.88
银行间市场交易费用	-
合计	90,030.88

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月14日（基金合同生效日）至2012年12月31日

指数使用费	295,785.57
信息披露费	150,000.00
审计费用	50,000.00
银行划款手续费	3,927.28
合计	499,712.85

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.085%的年费率每日计提，逐日累计，按年支付，标的指数许可使用费的收取下限为每年85,000.00美元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行	境外资产托管人
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
上海丰益股权投资基金有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2012年6月14日(基金合同生效日)至 2012年12月31日止期间
当期发生的基金应支付的管理费	567,591.91
其中：支付销售机构的客户维护费	102,026.55

注：支付基金管理人博时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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间
当期发生的基金应支付的托管费	141,897.98

注：支付基金托管人中国工商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2012 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,409,200.75	88,584.34
纽约梅隆银行	744,180.45	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	12/09/21	12/09/20	0.280	740,115.09	374,239.07	1,114,354.16	
合计			0.280	740,115.09	374,239.07	1,114,354.16	

7.4.12 期末(2012 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式投资的股票指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪美国市场股票指数，目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益特征的开放式基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和基金投资等。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，力争控制基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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，将风险控制于可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外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，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成

证券交收和款项清算，违约风险不重大。在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金投资于远期合约时，任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。本基金所持大部分证券和衍生工具在境内外证券交易所上市或在场外市场交易，均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为 3 个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	---------	-------	-----	----

2012 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,153,381.20	-	-	-	4,153,381.20
结算备付金	412,639.93	-	-	-	412,639.93
存出保证金	-	-	-	219,992.50	219,992.50
交易性金融资产	-	-	-	57,100,458.21	57,100,458.21
应收利息	-	-	-	763.11	763.11
应收股利	-	-	-	60,797.95	60,797.95
应收申购款	-	-	-	554,458.14	554,458.14
资产总计	4,566,021.13	-	-	57,936,469.91	62,502,491.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	510,374.65	510,374.65
应付管理人报酬	-	-	-	56,902.72	56,902.72
应付托管费	-	-	-	14,225.66	14,225.66
其他负债	-	-	-	397,708.97	397,708.97
负债总计	-	-	-	979,212.00	979,212.00
利率敏感度缺口	4,566,021.13	-	-	56,957,257.91	61,523,279.04

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	744,576.69	-	744,576.69
结算备付金	412,639.93	-	412,639.93
存出保证金	219,992.50	-	219,992.50
交易性金融资产	57,100,458.21	-	57,100,458.21
应收利息	12.76	-	12.76
应收股利	60,797.95	-	60,797.95
资产合计	58,538,478.04	-	58,538,478.04
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	58,538,478.04	-	58,538,478.04

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	
	所有外币均相对人民币升值 5%		增加约 293
	所有外币均相对人民币贬值 5%		减少约 293

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的基金和股票，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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%；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。针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	57,100,458.21	92.81
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-

合计	57,100,458.21	92.81
----	---------------	-------

注：于2012年12月31日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注7.4.7.3衍生金融资产/负债。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2012年12月31日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

不以公允价值计量的金融工具

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

以公允价值计量的金融工具

金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为57,100,458.21元，无属于第二层级和第三层级的余额。

公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	57,100,458.21	91.36
	其中：普通股	55,836,276.24	89.33

	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	1,264,181.97	2.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	-	-
	期货	0.00	0.00
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,566,021.13	7.31
8	其他各项资产	836,011.70	1.34
9	合计	62,502,491.04	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动(人民币元)
股指期货	ESH3	S&P500 EMINI FUT Mar13	10	4,463,019.28	-8,799.70
总额合计					-8,799.70
减：可抵消期货 暂收款					-8,799.70
股指期货投资净 额					0.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	57,100,458.21	92.81
合计	57,100,458.21	92.81

8.3 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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
------	------------	--------------

信息科技	10,895,171.30	17.71
金融	8,796,907.08	14.30
医疗保健	6,874,209.84	11.17
非必需消费品	6,585,320.56	10.70
能源	6,286,541.03	10.22
必需消费品	6,071,713.48	9.87
工业	5,798,558.46	9.42
原材料	2,076,610.61	3.38
公用事业	1,966,103.07	3.20
电信业务	1,749,322.78	2.84
合计	57,100,458.21	92.81

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券市 场	所属国 家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	美国证券交 易所	美国	672.00	2,251,441.96	3.66
2	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	美国证券交 易所	美国	3,254.00	1,770,208.62	2.88
3	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	美国证券交 易所	美国	7,483.00	987,251.98	1.60
4	CHEVRON CORP	-	CVX US	美国证券交 易所	美国	1,397.00	949,560.42	1.54
5	INTL BUSINESS MACHINES CORP	-	IBM US	美国证券交 易所	美国	758.00	912,622.54	1.48
6	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	美国证券交 易所	美国	5,405.00	908,101.70	1.48
7	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	美国证券交 易所	美国	1,978.00	871,533.60	1.42
8	AT&T INC	-	T US	美国证券交 易所	美国	4,053.00	858,766.68	1.40
9	GOOGLE INC-CL A	-	GOOG US	美国证券交 易所	美国	190.00	847,161.58	1.38

10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	PG US	美国证券交易所	美国	1,951.00	832,535.78	1.35
11	PFIZER INC	-	PFE US	美国证券交易所	美国	5,254.00	828,242.35	1.35
12	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	美国证券交易所	美国	3,494.00	750,645.33	1.22
13	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	美国证券交易所	美国	2,713.00	749,801.13	1.22
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	美国证券交易所	美国	1,302.00	734,079.77	1.19
15	COCA-COLA CO/THE	-	KO US	美国证券交易所	美国	2,753.00	627,269.33	1.02
16	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	-	PM US	美国证券交易所	美国	1,192.00	626,657.31	1.02
17	ORACLE CORP	-	ORCL US	美国证券交易所	美国	2,683.00	561,908.36	0.91
18	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC US	美国证券交易所	美国	7,691.00	560,764.65	0.91
19	MERCK & CO. INC.	-	MRK US	美国证券交易所	美国	2,170.00	558,402.56	0.91
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	-	VZ US	美国证券交易所	美国	2,037.00	554,010.19	0.90
21	CITIGROUP INC	-	C US	美国证券交易所	美国	2,093.00	520,433.62	0.85
22	WAL-MART STORES INC	-	WMT US	美国证券交易所	美国	1,194.00	512,058.44	0.83
23	PEPSICO INC	-	PEP US	美国证券交易所	美国	1,104.00	474,848.91	0.77
24	QUALCOMM INC	-	QCOM US	美国证券交易所	美国	1,216.00	474,029.28	0.77
25	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO US	美国证券交易所	美国	3,789.00	467,979.67	0.76
26	ABBOTT LABORATORIES	-	ABT US	美国证券交易所	美国	1,128.00	464,397.88	0.75
27	INTEL CORP	-	INTC US	美国证券交易所	美国	3,551.00	460,457.69	0.75

28	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA US	美国证券交 易所	美国	1,896.00	445,468.97	0.72
29	HOME DEPOT INC	-	HD US	美国证券交 易所	美国	1,067.00	414,804.97	0.67
30	SCHLUMBERG ER LTD	-	SLB US	美国证券交 易所	美国	948.00	412,875.14	0.67
31	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	美国证券交 易所	美国	259.00	408,841.98	0.66
32	MCDONALD'S CORP	-	MCD US	美国证券交 易所	美国	717.00	397,536.32	0.65
33	WALT DISNEY CO/THE	-	DIS US	美国证券交 易所	美国	1,265.00	395,888.13	0.64
34	VISA INC-CLASS A SHARES	-	V US	美国证券交 易所	美国	372.00	354,425.27	0.58
35	CONOCOPHIL LIPS	-	COP US	美国证券交 易所	美国	867.00	316,018.16	0.51
36	UNITED TECHNOLOGI ES CORP	-	UTX US	美国证券交 易所	美国	602.00	310,315.26	0.50
37	AMGEN INC	-	AMGN US	美国证券交 易所	美国	548.00	297,325.27	0.48
38	ALTRIA GROUP INC	-	MO US	美国证券交 易所	美国	1,445.00	285,373.64	0.46
39	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY US	美国证券交 易所	美国	579.00	278,807.12	0.45
40	CVS CAREMARK CORP	-	CVS US	美国证券交 易所	美国	890.00	270,474.49	0.44
41	US BANCORP	-	USB US	美国证券交 易所	美国	1,342.00	269,418.40	0.44
42	EBAY INC	-	EBAY US	美国证券交 易所	美国	831.00	266,490.24	0.43
43	3M CO	-	MMM US	美国证券交 易所	美国	455.00	265,541.95	0.43
44	UNION PACIFIC CORP	-	UNP US	美国证券交 易所	美国	336.00	265,511.59	0.43
45	CATERPILLA R INC	-	CAT US	美国证券交 易所	美国	467.00	262,946.73	0.43

46	GOLDMAN SACHS GROUP INC	-	GS US	美国证券交易所	美国	316.00	253,361.97	0.41
47	AMERICAN EXPRESS CO	-	AXP US	美国证券交易所	美国	695.00	251,096.93	0.41
48	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	美国证券交易所	美国	541.00	249,763.46	0.41
49	UNITEDHEALTH GROUP INC	-	UNH US	美国证券交易所	美国	729.00	248,534.70	0.40
50	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	BMJ US	美国证券交易所	美国	1,178.00	241,306.76	0.39
51	EMC CORP/MA	-	EMC US	美国证券交易所	美国	1,504.00	239,170.82	0.39
52	MASTERCARD INC-CLASS A	-	MA US	美国证券交易所	美国	77.00	237,771.41	0.39
53	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	-	UPS US	美国证券交易所	美国	511.00	236,812.69	0.38
54	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	-	AIG US	美国证券交易所	美国	1,054.00	233,859.57	0.38
55	NEWS CORP-CL A	-	NWSA US	美国证券交易所	美国	1,439.00	231,005.07	0.38
56	BOEING CO/THE	-	BA US	美国证券交易所	美国	485.00	229,732.51	0.37
57	MONSANTO CO	-	MON US	美国证券交易所	美国	382.00	227,260.42	0.37
58	ELI LILLY & CO	-	LLY US	美国证券交易所	美国	729.00	225,990.63	0.37
59	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	-	HON US	美国证券交易所	美国	559.00	223,007.84	0.36
60	FORD MOTOR CO	-	F US	美国证券交易所	美国	2,721.00	221,481.85	0.36
61	SIMON PROPERTY GROUP INC	-	SPG US	美国证券交易所	美国	221.00	219,602.11	0.36
62	COLGATE-PALMOLIVE CO	-	CL US	美国证券交易所	美国	317.00	208,296.32	0.34

63	TIME WARNER INC	-	TWX US	美国证券交易所	美国	676.00	203,229.57	0.33
64	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	-	MDLZ US	美国证券交易所	美国	1,268.00	202,996.26	0.33
65	DUKE ENERGY CORP	-	DUK US	美国证券交易所	美国	503.00	201,710.49	0.33
66	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	-	ESRX US	美国证券交易所	美国	583.00	197,880.11	0.32
67	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST US	美国证券交易所	美国	309.00	191,833.02	0.31
68	ACCENTURE PLC-CL A	-	ACN US	美国证券交易所	美国	456.00	190,601.50	0.31
69	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	-	DD US	美国证券交易所	美国	666.00	188,250.85	0.31
70	MEDTRONIC INC	-	MDT US	美国证券交易所	美国	722.00	186,154.13	0.30
71	LOWE'S COS INC	-	LOW US	美国证券交易所	美国	803.00	179,278.55	0.29
72	STARBUCKS CORP	-	SBUX US	美国证券交易所	美国	531.00	178,962.14	0.29
73	DOW CHEMICAL CO/THE	-	DOW US	美国证券交易所	美国	856.00	173,894.14	0.28
74	TARGET CORP	-	TGT US	美国证券交易所	美国	465.00	172,939.56	0.28
75	EMERSON ELECTRIC CO	-	EMR US	美国证券交易所	美国	517.00	172,099.00	0.28
76	NIKE INC -CL B	-	NKE US	美国证券交易所	美国	522.00	169,301.20	0.28
77	SOUTHERN CO/THE	-	SO US	美国证券交易所	美国	624.00	167,907.33	0.27
78	ANADARKO PETROLEUM CORP	-	APC US	美国证券交易所	美国	357.00	166,745.96	0.27
79	BAXTER INTERNATIONAL INC	-	BAX US	美国证券交易所	美国	392.00	164,244.64	0.27
80	METLIFE	-	MET US	美国证券交	美国	779.00	161,287.56	0.26

	INC			易所				
81	BIOGEN IDEC INC	-	BIIB US	美国证券交 易所	美国	169.00	155,800.13	0.25
82	TEXAS INSTRUMENT S INC	-	TXN US	美国证券交 易所	美国	800.00	155,578.70	0.25
83	DEERE & CO	-	DE US	美国证券交 易所	美国	280.00	152,094.01	0.25
84	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	-	COF US	美国证券交 易所	美国	416.00	151,473.51	0.25
85	CELGENE CORP	-	CELG US	美国证券交 易所	美国	302.00	149,427.96	0.24
86	PHILLIPS 66	-	PSX US	美国证券交 易所	美国	447.00	149,190.74	0.24
87	KIMBERLY-C LARK CORP	-	KMB US	美国证券交 易所	美国	280.00	148,591.73	0.24
88	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	美国证券交 易所	美国	194.00	147,289.76	0.24
89	PRAXAIR INC	-	PX US	美国证券交 易所	美国	213.00	146,532.92	0.24
90	DANAHER CORP	-	DHR US	美国证券交 易所	美国	416.00	146,165.53	0.24
91	FREEPORT-M CMORAN COPPER	-	FCX US	美国证券交 易所	美国	678.00	145,745.66	0.24
92	HALLIBURTO N CO	-	HAL US	美国证券交 易所	美国	663.00	144,563.17	0.23
93	WALGREEN CO	-	WAG US	美国证券交 易所	美国	613.00	142,599.96	0.23
94	PRICELINE. COM INC	-	PCLN US	美国证券交 易所	美国	36.00	140,563.89	0.23
95	TJX COMPANIES INC	-	TJX US	美国证券交 易所	美国	521.00	139,012.95	0.23
96	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	-	PNC US	美国证券交 易所	美国	378.00	138,539.84	0.23
97	APACHE CORP	-	APA US	美国证券交 易所	美国	280.00	138,155.29	0.22

98	AMERICAN TOWER CORP	-	AMT US	美国证券交易所	美国	283.00	137,447.61	0.22
99	DIRECTV	-	DTV US	美国证券交易所	美国	432.00	136,201.25	0.22
100	YUM! BRANDS INC	-	YUM US	美国证券交易所	美国	323.00	134,806.38	0.22
101	DOMINION RESOURCES INC/VA	-	D US	美国证券交易所	美国	410.00	133,491.45	0.22
102	TIME WARNER CABLE	-	TWC US	美国证券交易所	美国	216.00	131,951.75	0.21
103	NEXTERA ENERGY INC	-	NEE US	美国证券交易所	美国	302.00	131,337.91	0.21
104	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV US	美国证券交易所	美国	305.00	131,032.25	0.21
105	ALLERGAN INC	-	AGN US	美国证券交易所	美国	220.00	126,845.16	0.21
106	HEWLETT-PACKARD CO	-	HPQ US	美国证券交易所	美国	1,403.00	125,664.43	0.20
107	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	美国证券交易所	美国	347.00	124,342.72	0.20
108	PRECISION CASTPARTS CORP	-	PCP US	美国证券交易所	美国	104.00	123,822.34	0.20
109	TRAVELERS COS INC/THE	-	TRV US	美国证券交易所	美国	273.00	123,238.92	0.20
110	COVIDIEN PLC	-	COV US	美国证券交易所	美国	338.00	122,668.57	0.20
111	ACE LTD	-	ACE US	美国证券交易所	美国	243.00	121,884.64	0.20
112	KRAFT FOODS GROUP INC	-	KRFT US	美国证券交易所	美国	423.00	120,894.11	0.20
113	FEDEX CORP	-	FDX US	美国证券交易所	美国	209.00	120,489.77	0.20
114	MORGAN STANLEY	-	MS US	美国证券交易所	美国	987.00	118,616.44	0.19
115	GENERAL MILLS INC	-	GIS US	美国证券交易所	美国	461.00	117,092.64	0.19
116	BLACKROCK	-	BLK US	美国证券交	美国	90.00	116,934.81	0.19

	INC			易所				
117	ILLINOIS TOOL WORKS	-	ITW US	美国证券交 易所	美国	305.00	116,577.48	0.19
118	EXELON CORP	-	EXC US	美国证券交 易所	美国	610.00	114,027.77	0.19
119	EATON CORP PLC	-	ETN US	美国证券交 易所	美国	330.00	112,422.45	0.18
120	AFLAC INC	-	AFL US	美国证券交 易所	美国	335.00	111,851.73	0.18
121	LOCKHEED MARTIN CORP	-	LMT US	美国证券交 易所	美国	192.00	111,377.05	0.18
122	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	-	PRU US	美国证券交 易所	美国	332.00	111,288.30	0.18
123	CENTURYLIN K INC	-	CTL US	美国证券交 易所	美国	446.00	109,666.39	0.18
124	VIACOM INC-CLASS B	-	VIAB US	美国证券交 易所	美国	330.00	109,394.10	0.18
125	NEWMONT MINING CORP	-	NEM US	美国证券交 易所	美国	355.00	103,624.01	0.17
126	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO US	美国证券交 易所	美国	258.00	103,429.41	0.17
127	GENERAL DYNAMICS CORP	-	GD US	美国证券交 易所	美国	237.00	103,188.99	0.17
128	MCKESSON CORP	-	MCK US	美国证券交 易所	美国	169.00	102,995.71	0.17
129	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	-	CBS US	美国证券交 易所	美国	422.00	100,926.90	0.16
130	KINDER MORGAN INC	-	KMI US	美国证券交 易所	美国	452.00	100,374.16	0.16
131	COGNIZANT TECH SOLUTIONS- A	-	CTSH US	美国证券交 易所	美国	215.00	100,069.87	0.16
132	SALESFORCE .COM INC	-	CRM US	美国证券交 易所	美国	94.00	99,319.70	0.16

133	WILLIAMS COS INC	-	WMB US	美国证券交 易所	美国	480.00	98,777.89	0.16
134	STATE STREET CORP	-	STT US	美国证券交 易所	美国	332.00	98,099.81	0.16
135	MARATHON OIL CORP	-	MRO US	美国证券交 易所	美国	505.00	97,320.28	0.16
136	LYONDELLBA SELL INDU-CL A	-	LYB US	美国证券交 易所	美国	271.00	97,245.42	0.16
137	MARATHON PETROLEUM CORP	-	MPC US	美国证券交 易所	美国	243.00	96,224.72	0.16
138	CROWN CASTLE INTL CORP	-	CCI US	美国证券交 易所	美国	210.00	95,247.95	0.15
139	JOHNSON CONTROLS INC	-	JCI US	美国证券交 易所	美国	488.00	94,166.85	0.15
140	PUBLIC STORAGE	-	PSA US	美国证券交 易所	美国	103.00	93,848.05	0.15
141	PPG INDUSTRIES INC	-	PPG US	美国证券交 易所	美国	110.00	93,581.67	0.15
142	AMERICAN ELECTRIC POWER	-	AEP US	美国证券交 易所	美国	347.00	93,088.00	0.15
143	YAHOO! INC	-	YHOO US	美国证券交 易所	美国	743.00	92,935.52	0.15
144	HCP INC	-	HCP US	美国证券交 易所	美国	323.00	91,725.18	0.15
145	BB&T CORP	-	BBT US	美国证券交 易所	美国	500.00	91,485.45	0.15
146	CSX CORP	-	CSX US	美国证券交 易所	美国	736.00	91,273.51	0.15
147	INTUITIVE SURGICAL INC	-	ISRG US	美国证券交 易所	美国	29.00	89,384.40	0.15
148	CHUBB CORP	-	CB US	美国证券交 易所	美国	187.00	88,530.26	0.14
149	DEVON ENERGY CORPORATIO N	-	DVN US	美国证券交 易所	美国	269.00	87,989.21	0.14

150	NORFOLK SOUTHERN CORP	-	NSC US	美国证券交易所	美国	226.00	87,845.14	0.14
151	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	美国证券交易所	美国	361.00	87,472.48	0.14
152	ALLSTATE CORP	-	ALL US	美国证券交易所	美国	344.00	86,856.06	0.14
153	CUMMINS INC	-	CMI US	美国证券交易所	美国	127.00	86,491.31	0.14
154	VENTAS INC	-	VTR US	美国证券交易所	美国	211.00	85,834.29	0.14
155	ECOLAB INC	-	ECL US	美国证券交易所	美国	189.00	85,414.29	0.14
156	RAYTHEON COMPANY	-	RTN US	美国证券交易所	美国	236.00	85,383.24	0.14
157	VALERO ENERGY CORP	-	VLO US	美国证券交易所	美国	395.00	84,712.20	0.14
158	MARSH & MCLENNAN COS	-	MMC US	美国证券交易所	美国	389.00	84,281.20	0.14
159	ADOBE SYSTEMS INC	-	ADBE US	美国证券交易所	美国	354.00	83,840.52	0.14
160	CORNING INC	-	GLW US	美国证券交易所	美国	1,055.00	83,685.78	0.14
161	SYSCO CORP	-	SYY US	美国证券交易所	美国	420.00	83,579.55	0.14
162	WELLPOINT INC	-	WLP US	美国证券交易所	美国	217.00	83,092.05	0.14
163	HJ HEINZ CO	-	HNZ US	美国证券交易所	美国	229.00	83,023.41	0.13
164	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	-	ALXN US	美国证券交易所	美国	139.00	81,960.34	0.13
165	EQUITY RESIDENTIAL	-	EQR US	美国证券交易所	美国	230.00	81,925.84	0.13
166	SPECTRA ENERGY CORP	-	SE US	美国证券交易所	美国	476.00	81,918.17	0.13
167	NOBLE ENERGY INC	-	NBL US	美国证券交易所	美国	127.00	81,214.82	0.13

168	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	ADM US	美国证券交易所	美国	470.00	80,915.13	0.13
169	BAKER HUGHES INC	-	BHI US	美国证券交易所	美国	314.00	80,603.74	0.13
170	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	-	APD US	美国证券交易所	美国	152.00	80,272.37	0.13
171	AON PLC	-	AON US	美国证券交易所	美国	228.00	79,680.03	0.13
172	INTERNATIONAL PAPER CO	-	IP US	美国证券交易所	美国	314.00	78,630.10	0.13
173	FIRSTENERGY CORP	-	FE US	美国证券交易所	美国	299.00	78,482.26	0.13
174	FRANKLIN RESOURCES INC	-	BEN US	美国证券交易所	美国	99.00	78,218.65	0.13
175	P G & E CORP	-	PCG US	美国证券交易所	美国	307.00	77,533.28	0.13
176	BROADCOM CORP-CL A	-	BRCM US	美国证券交易所	美国	371.00	77,443.08	0.13
177	SPRINT NEXTEL CORP	-	S US	美国证券交易所	美国	2,144.00	76,409.56	0.12
178	PROLOGIS INC	-	PLD US	美国证券交易所	美国	329.00	75,458.75	0.12
179	PPL CORPORATION	-	PPL US	美国证券交易所	美国	416.00	74,860.81	0.12
180	NORTHROP GRUMMAN CORP	-	NOC US	美国证券交易所	美国	176.00	74,760.24	0.12
181	T ROWE PRICE GROUP INC	-	TROW US	美国证券交易所	美国	182.00	74,506.18	0.12
182	INTUIT INC	-	INTU US	美国证券交易所	美国	199.00	74,423.46	0.12
183	CARNIVAL CORP	-	CCL US	美国证券交易所	美国	319.00	73,726.59	0.12
184	CONSOLIDATED EDISON INC	-	ED US	美国证券交易所	美国	209.00	72,961.20	0.12

185	BOSTON PROPERTIES INC	-	BXP US	美国证券交 易所	美国	108.00	71,827.43	0.12
186	SEMPRA ENERGY	-	SRE US	美国证券交 易所	美国	161.00	71,788.83	0.12
187	HEALTH CARE REIT INC	-	HCN US	美国证券交 易所	美国	186.00	71,654.32	0.12
188	PACCAR INC	-	PCAR US	美国证券交 易所	美国	252.00	71,610.20	0.12
189	STRYKER CORP	-	SYK US	美国证券交 易所	美国	207.00	71,326.22	0.12
190	WHOLE FOODS MARKET INC	-	WFM US	美国证券交 易所	美国	124.00	71,182.78	0.12
191	HESS CORP	-	HES US	美国证券交 易所	美国	213.00	70,903.46	0.12
192	COACH INC	-	COH US	美国证券交 易所	美国	203.00	70,828.35	0.12
193	SCHWAB (CHARLES) CORP	-	SCHW US	美国证券交 易所	美国	783.00	70,673.41	0.11
194	MOSAIC CO/THE	-	MOS US	美国证券交 易所	美国	198.00	70,477.68	0.11
195	TE CONNECTIVI TY LTD	-	TEL US	美国证券交 易所	美国	302.00	70,461.96	0.11
196	MOTOROLA SOLUTIONS INC	-	MSI US	美国证券交 易所	美国	201.00	70,345.30	0.11
197	AVALONBAY COMMUNITIE S INC	-	AVB US	美国证券交 易所	美国	82.00	69,884.58	0.11
198	CME GROUP INC	-	CME US	美国证券交 易所	美国	219.00	69,803.56	0.11
199	AETNA INC	-	AET US	美国证券交 易所	美国	239.00	69,553.46	0.11
200	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	-	PEG US	美国证券交 易所	美国	361.00	69,433.40	0.11
201	MACY'S INC	-	M US	美国证券交 易所	美国	283.00	69,408.64	0.11

202	BECTON DICKINSON AND CO	-	BDX US	美国证券交 易所	美国	141.00	69,296.32	0.11
203	SUNTRUST BANKS INC	-	STI US	美国证券交 易所	美国	385.00	68,604.66	0.11
204	CIGNA CORP	-	CI US	美国证券交 易所	美国	204.00	68,548.66	0.11
205	MCGRAW-HIL L COMPANIES INC	-	MHP US	美国证券交 易所	美国	199.00	68,382.03	0.11
206	DISCOVERY COMMUNICAT IONS-A	-	DISCA US	美国证券交 易所	美国	171.00	68,229.61	0.11
207	LORILLARD INC	-	LO US	美国证券交 易所	美国	93.00	68,199.62	0.11
208	WEYERHAEUS ER CO	-	WY US	美国证券交 易所	美国	387.00	67,671.83	0.11
209	DELL INC	-	DELL US	美国证券交 易所	美国	1,042.00	66,346.34	0.11
210	EDISON INTERNATIO NAL	-	EIX US	美国证券交 易所	美国	233.00	66,181.73	0.11
211	WASTE MANAGEMENT INC	-	WM US	美国证券交 易所	美国	312.00	66,166.70	0.11
212	ESTEE LAUDER COMPANIES- CL A	-	EL US	美国证券交 易所	美国	172.00	64,715.01	0.11
213	AGILENT TECHNOLOGI ES INC	-	A US	美国证券交 易所	美国	249.00	64,074.76	0.10
214	CARDINAL HEALTH INC	-	CAH US	美国证券交 易所	美国	243.00	62,897.36	0.10
215	CAMERON INTERNATIO NAL CORP	-	CAM US	美国证券交 易所	美国	177.00	62,813.64	0.10
216	KELLOGG CO	-	K US	美国证券交 易所	美国	177.00	62,135.00	0.10
217	ENSCO PLC-CL A	-	ESV US	美国证券交 易所	美国	166.00	61,852.34	0.10
218	NUCOR CORP	-	NUE US	美国证券交 易所	美国	227.00	61,609.59	0.10

219	APPLIED MATERIALS INC	-	AMAT US	美国证券交易所	美国	855.00	61,479.73	0.10
220	TYCO INTERNATIONAL LTD	-	TYC US	美国证券交易所	美国	333.00	61,222.34	0.10
221	FIFTH THIRD BANCORP	-	FITB US	美国证券交易所	美国	641.00	61,200.59	0.10
222	VORNADO REALTY TRUST	-	VNO US	美国证券交易所	美国	121.00	60,904.48	0.10
223	REYNOLDS AMERICAN INC	-	RAI US	美国证券交易所	美国	232.00	60,414.72	0.10
224	INGERSOLL-RAND PLC	-	IR US	美国证券交易所	美国	200.00	60,290.52	0.10
225	AUTOZONE INC	-	AZO US	美国证券交易所	美国	27.00	60,149.78	0.10
226	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	-	MJN US	美国证券交易所	美国	145.00	60,051.98	0.10
227	KROGER CO	-	KR US	美国证券交易所	美国	367.00	60,022.38	0.10
228	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	-	SHW US	美国证券交易所	美国	62.00	59,943.81	0.10
229	VF CORP	-	VFC US	美国证券交易所	美国	63.00	59,782.08	0.10
230	OMNICOM GROUP	-	OMC US	美国证券交易所	美国	189.00	59,350.46	0.10
231	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	-	PXD US	美国证券交易所	美国	88.00	58,957.49	0.10
232	SYMANTEC CORP	-	SYMC US	美国证券交易所	美国	496.00	58,642.21	0.10
233	XCEL ENERGY INC	-	XEL US	美国证券交易所	美国	348.00	58,424.23	0.09
234	AMERIPRISE FINANCIAL INC	-	AMP US	美国证券交易所	美国	147.00	57,868.15	0.09

235	BED BATH & BEYOND INC	-	BBBY US	美国证券交易所	美国	164.00	57,633.26	0.09
236	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	-	CF US	美国证券交易所	美国	45.00	57,463.30	0.09
237	PARKER HANNIFIN CORP	-	PH US	美国证券交易所	美国	107.00	57,206.98	0.09
238	ANALOG DEVICES INC	-	ADI US	美国证券交易所	美国	216.00	57,103.52	0.09
239	LOEWS CORP	-	L US	美国证券交易所	美国	222.00	56,861.78	0.09
240	FASTENAL CO	-	FAST US	美国证券交易所	美国	193.00	56,639.71	0.09
241	MATTEL INC	-	MAT US	美国证券交易所	美国	245.00	56,392.88	0.09
242	STANLEY BLACK & DECKER INC	-	SWK US	美国证券交易所	美国	121.00	56,257.55	0.09
243	CITRIX SYSTEMS INC	-	CTXS US	美国证券交易所	美国	134.00	55,378.40	0.09
244	NORTHEAST UTILITIES	-	NU US	美国证券交易所	美国	225.00	55,268.40	0.09
245	WW GRAINGER INC	-	GWV US	美国证券交易所	美国	43.00	54,695.86	0.09
246	ROSS STORES INC	-	ROST US	美国证券交易所	美国	159.00	54,117.21	0.09
247	NETAPP INC	-	NTAP US	美国证券交易所	美国	256.00	53,984.90	0.09
248	CONAGRA FOODS INC	-	CAG US	美国证券交易所	美国	291.00	53,957.87	0.09
249	M & T BANK CORP	-	MTB US	美国证券交易所	美国	87.00	53,847.19	0.09
250	DOVER CORP	-	DOV US	美国证券交易所	美国	128.00	52,866.59	0.09
251	ROCKWELL AUTOMATION INC	-	ROK US	美国证券交易所	美国	100.00	52,791.91	0.09
252	PROGRESSIVE CORP	-	PGR US	美国证券交易所	美国	397.00	52,651.75	0.09

253	SOUTHWESTERN ENERGY CO	-	SWN US	美国证券交易所	美国	250.00	52,499.64	0.09
254	DOLLAR GENERAL CORP	-	DG US	美国证券交易所	美国	188.00	52,100.01	0.08
255	INVESCO LTD	-	IVZ US	美国证券交易所	美国	317.00	51,984.42	0.08
256	ZIMMER HOLDINGS INC	-	ZMH US	美国证券交易所	美国	124.00	51,954.94	0.08
257	CERNER CORP	-	CERN US	美国证券交易所	美国	105.00	51,240.65	0.08
258	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	HST US	美国证券交易所	美国	518.00	51,019.78	0.08
259	ENTERGY CORP	-	ETR US	美国证券交易所	美国	127.00	50,888.98	0.08
260	LIMITED BRANDS INC	-	LTD US	美国证券交易所	美国	171.00	50,581.05	0.08
261	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	-	DLPH US	美国证券交易所	美国	210.00	50,488.28	0.08
262	STARWOOD HOTELS & RESORTS	-	HOT US	美国证券交易所	美国	140.00	50,475.08	0.08
263	MYLAN INC	-	MYL US	美国证券交易所	美国	291.00	50,263.13	0.08
264	ST JUDE MEDICAL INC	-	STJ US	美国证券交易所	美国	220.00	49,974.75	0.08
265	ROPER INDUSTRIES INC	-	ROP US	美国证券交易所	美国	71.00	49,750.24	0.08
266	HARLEY-DAVIDSON INC	-	HOG US	美国证券交易所	美国	162.00	49,731.38	0.08
267	ACTAVIS INC	-	ACT US	美国证券交易所	美国	92.00	49,730.88	0.08
268	ALTERA CORP	-	ALTR US	美国证券交易所	美国	229.00	49,572.23	0.08
269	MURPHY OIL CORP	-	MUR US	美国证券交易所	美国	132.00	49,407.80	0.08

270	NORTHERN TRUST CORP	-	NTRS US	美国证券交易所	美国	156.00	49,183.79	0.08
271	HUMANA INC	-	HUM US	美国证券交易所	美国	113.00	48,745.25	0.08
272	HERSHEY CO/THE	-	HSY US	美国证券交易所	美国	107.00	48,571.45	0.08
273	ADT CORP/THE	-	ADT US	美国证券交易所	美国	166.00	48,507.34	0.08
274	FISERV INC	-	FISV US	美国证券交易所	美国	96.00	47,687.33	0.08
275	SANDISK CORP	-	SNDK US	美国证券交易所	美国	173.00	47,366.77	0.08
276	TERADATA CORP	-	TDC US	美国证券交易所	美国	121.00	47,070.16	0.08
277	EASTMAN CHEMICAL CO	-	EMN US	美国证券交易所	美国	110.00	47,050.11	0.08
278	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	-	EW US	美国证券交易所	美国	83.00	47,041.37	0.08
279	CABOT OIL & GAS CORP	-	COG US	美国证券交易所	美国	150.00	46,896.12	0.08
280	AMPHENOL CORP-CL A	-	APH US	美国证券交易所	美国	115.00	46,767.26	0.08
281	PENTAIR LTD-REGISTERED	-	PNR US	美国证券交易所	美国	151.00	46,648.78	0.08
282	DTE ENERGY COMPANY	-	DTE US	美国证券交易所	美国	123.00	46,425.65	0.08
283	RANGE RESOURCES CORP	-	RRC US	美国证券交易所	美国	117.00	46,205.40	0.08
284	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	-	CHRW US	美国证券交易所	美国	116.00	46,094.84	0.07
285	O' REILLY AUTOMOTIVE INC	-	ORLY US	美国证券交易所	美国	82.00	46,088.05	0.07
286	SEAGATE TECHNOLOGY	-	STX US	美国证券交易所	美国	240.00	45,979.69	0.07
287	RED HAT INC	-	RHT US	美国证券交易所	美国	138.00	45,937.45	0.07

288	AMERISOURC EBERGEN CORP	-	ABC US	美国证券交 易所	美国	169.00	45,867.93	0.07
289	FMC TECHNOLOGI ES INC	-	FTI US	美国证券交 易所	美国	170.00	45,765.35	0.07
290	JUNIPER NETWORKS INC	-	JNPR US	美国证券交 易所	美国	368.00	45,497.97	0.07
291	PAYCHEX INC	-	PAYX US	美国证券交 易所	美国	231.00	45,213.74	0.07
292	REGIONS FINANCIAL CORP	-	RF US	美国证券交 易所	美国	1,009.00	45,155.53	0.07
293	GENUINE PARTS CO	-	GPC US	美国证券交 易所	美国	111.00	44,359.16	0.07
294	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	-	HIG US	美国证券交 易所	美国	312.00	44,006.55	0.07
295	MOODY'S CORP	-	MCO US	美国证券交 易所	美国	139.00	43,963.80	0.07
296	FLUOR CORP	-	FLR US	美国证券交 易所	美国	119.00	43,936.02	0.07
297	BEAM INC	-	BEAM US	美国证券交 易所	美国	114.00	43,773.86	0.07
298	BROWN-FORM AN CORP-CLASS B	-	BF/B US	美国证券交 易所	美国	109.00	43,333.81	0.07
299	CLOROX COMPANY	-	CLX US	美国证券交 易所	美国	94.00	43,261.09	0.07
300	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	-	CMG US	美国证券交 易所	美国	23.00	43,002.75	0.07
301	JM SMUCKER CO/THE	-	SJM US	美国证券交 易所	美国	78.00	42,280.80	0.07
302	XILINX INC	-	XLNX US	美国证券交 易所	美国	187.00	42,196.45	0.07
303	WESTERN DIGITAL CORP	-	WDC US	美国证券交 易所	美国	157.00	41,930.13	0.07
304	QUEST DIAGNOSTIC S INC	-	DGX US	美国证券交 易所	美国	114.00	41,753.19	0.07

305	DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	-	DVA US	美国证券交 易所	美国	60.00	41,684.18	0.07
306	ALCOA INC	-	AA US	美国证券交 易所	美国	762.00	41,573.30	0.07
307	GAP INC/THE	-	GPS US	美国证券交 易所	美国	213.00	41,556.71	0.07
308	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	美国证券交 易所	美国	163.00	41,555.20	0.07
309	RALPH LAUREN CORP	-	RL US	美国证券交 易所	美国	44.00	41,462.18	0.07
310	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	-	DPS US	美国证券交 易所	美国	149.00	41,376.32	0.07
311	MARRIOTT INTERNATIO NAL -CL A	-	MAR US	美国证券交 易所	美国	176.00	41,229.86	0.07
312	PERRIGO CO	-	PRGO US	美国证券交 易所	美国	63.00	41,194.48	0.07
313	KOHL'S CORP	-	KSS US	美国证券交 易所	美国	151.00	40,792.77	0.07
314	INTERCONTI NENTALEXCH ANGE INC	-	ICE US	美国证券交 易所	美国	52.00	40,466.80	0.07
315	WYNN RESORTS LTD	-	WYNN US	美国证券交 易所	美国	57.00	40,302.19	0.07
316	SIGMA-ALDR ICH	-	SIAL US	美国证券交 易所	美国	86.00	39,773.89	0.06
317	EQT CORP	-	EQT US	美国证券交 易所	美国	107.00	39,666.91	0.06
318	NOBLE CORP	-	NE US	美国证券交 易所	美国	181.00	39,613.86	0.06
319	REPUBLIC SERVICES INC	-	RSG US	美国证券交 易所	美国	214.00	39,451.70	0.06
320	ONEOK INC	-	OKE US	美国证券交 易所	美国	146.00	39,230.95	0.06
321	FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	-	FIS US	美国证券交 易所	美国	178.00	38,946.09	0.06
322	CARMAX INC	-	KMX US	美国证券交 易所	美国	164.00	38,697.06	0.06

323	XEROX CORP	-	XRX US	美国证券交易所	美国	902.00	38,666.13	0.06
324	CHESAPEAKE ENERGY CORP	-	CHK US	美国证券交易所	美国	370.00	38,652.05	0.06
325	COCA-COLA ENTERPRISES	-	CCE US	美国证券交易所	美国	193.00	38,491.71	0.06
326	WISCONSIN ENERGY CORP	-	WEC US	美国证券交易所	美国	165.00	38,217.41	0.06
327	LIFE TECHNOLOGIES CORP	-	LIFE US	美国证券交易所	美国	123.00	37,944.56	0.06
328	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	-	MKC US	美国证券交易所	美国	95.00	37,935.19	0.06
329	BORGWARNER INC	-	BWA US	美国证券交易所	美国	84.00	37,814.07	0.06
330	FOREST LABORATORIES INC	-	FRX US	美国证券交易所	美国	168.00	37,296.65	0.06
331	EXPEDITORS INTL WASH INC	-	EXPD US	美国证券交易所	美国	150.00	37,288.73	0.06
332	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	-	LH US	美国证券交易所	美国	68.00	37,022.60	0.06
333	ROCKWELL COLLINS INC	-	COL US	美国证券交易所	美国	101.00	36,928.38	0.06
334	CENTERPOINT ENERGY INC	-	CNP US	美国证券交易所	美国	305.00	36,903.74	0.06
335	NORDSTROM INC	-	JWN US	美国证券交易所	美国	109.00	36,653.89	0.06
336	WESTERN UNION CO	-	WU US	美国证券交易所	美国	426.00	36,442.45	0.06
337	FMC CORP	-	FMC US	美国证券交易所	美国	99.00	36,414.92	0.06
338	STERICYCLE INC	-	SRCL US	美国证券交易所	美国	62.00	36,347.41	0.06
339	WHIRLPOOL CORP	-	WHR US	美国证券交易所	美国	56.00	35,814.78	0.06

340	LINEAR TECHNOLOGY CORP	-	LLTC US	美国证券交易所	美国	166.00	35,788.38	0.06
341	AUTODESK INC	-	ADSK US	美国证券交易所	美国	161.00	35,772.98	0.06
342	KLA-TENCOR CORPORATION	-	KLAC US	美国证券交易所	美国	119.00	35,723.26	0.06
343	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST US	美国证券交易所	美国	107.00	35,564.36	0.06
344	SLM CORP	-	SLM US	美国证券交易所	美国	330.00	35,531.30	0.06
345	KIMCO REALTY CORP	-	KIM US	美国证券交易所	美国	291.00	35,337.84	0.06
346	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	-	PFG US	美国证券交易所	美国	197.00	35,314.70	0.06
347	KEYCORP	-	KEY US	美国证券交易所	美国	667.00	35,300.25	0.06
348	BOSTON SCIENTIFIC CORP	-	BSX US	美国证券交易所	美国	980.00	35,295.60	0.06
349	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	-	VAR US	美国证券交易所	美国	79.00	34,877.99	0.06
350	F5 NETWORKS INC	-	FFIV US	美国证券交易所	美国	57.00	34,806.27	0.06
351	NISOURCE INC	-	NI US	美国证券交易所	美国	222.00	34,731.03	0.06
352	WATERS CORP	-	WAT US	美国证券交易所	美国	63.00	34,498.34	0.06
353	NYSE EURONEXT	-	NYX US	美国证券交易所	美国	174.00	34,494.57	0.06
354	STAPLES INC	-	SPLS US	美国证券交易所	美国	481.00	34,465.91	0.06
355	NVIDIA CORP	-	NVDA US	美国证券交易所	美国	446.00	34,452.96	0.06
356	SOUTHWEST AIRLINES CO	-	LUV US	美国证券交易所	美国	527.00	33,919.58	0.06

357	XL GROUP PLC	-	XL US	美国证券交易所	美国	215.00	33,865.65	0.06
358	CR BARD INC	-	BCR US	美国证券交易所	美国	55.00	33,788.96	0.05
359	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	-	WYN US	美国证券交易所	美国	101.00	33,779.60	0.05
360	AMEREN CORPORATION	-	AEE US	美国证券交易所	美国	174.00	33,597.76	0.05
361	FLOWSERVE CORP	-	FLS US	美国证券交易所	美国	36.00	33,217.61	0.05
362	CA INC	-	CA US	美国证券交易所	美国	240.00	33,157.27	0.05
363	NRG ENERGY INC	-	NRG US	美国证券交易所	美国	229.00	33,091.33	0.05
364	PETSMART INC	-	PETM US	美国证券交易所	美国	77.00	33,075.43	0.05
365	CONSOL ENERGY INC	-	CNX US	美国证券交易所	美国	163.00	32,887.62	0.05
366	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	-	LLL US	美国证券交易所	美国	68.00	32,748.46	0.05
367	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	-	AKAM US	美国证券交易所	美国	127.00	32,656.76	0.05
368	PLUM CREEK TIMBER CO	-	PCL US	美国证券交易所	美国	116.00	32,350.97	0.05
369	PEABODY ENERGY CORP	-	BTU US	美国证券交易所	美国	192.00	32,113.37	0.05
370	LINCOLN NATIONAL CORP	-	LNC US	美国证券交易所	美国	197.00	32,070.51	0.05
371	TEXTRON INC	-	TXT US	美国证券交易所	美国	202.00	31,475.14	0.05
372	TIFFANY & CO	-	TIF US	美国证券交易所	美国	86.00	30,995.31	0.05
373	BALL CORP	-	BLL US	美国证券交易所	美国	110.00	30,940.37	0.05
374	JOY GLOBAL INC	-	JOY US	美国证券交易所	美国	76.00	30,467.58	0.05

375	VULCAN MATERIALS CO	-	VMC US	美国证券交 易所	美国	93.00	30,425.91	0.05
376	PALL CORP	-	PLL US	美国证券交 易所	美国	80.00	30,301.14	0.05
377	MOLSON COORS BREWING CO -B	-	TAP US	美国证券交 易所	美国	112.00	30,123.13	0.05
378	AES CORP	-	AES US	美国证券交 易所	美国	441.00	29,659.39	0.05
379	AIRGAS INC	-	ARG US	美国证券交 易所	美国	51.00	29,263.97	0.05
380	EQUIFAX INC	-	EFX US	美国证券交 易所	美国	86.00	29,254.73	0.05
381	MICRON TECHNOLOGY INC	-	MU US	美国证券交 易所	美国	727.00	29,016.70	0.05
382	CMS ENERGY CORP	-	CMS US	美国证券交 易所	美国	189.00	28,962.45	0.05
383	NEWELL RUBBERMAID INC	-	NWL US	美国证券交 易所	美国	206.00	28,835.49	0.05
384	LENNAR CORP-A	-	LEN US	美国证券交 易所	美国	118.00	28,681.11	0.05
385	CAREFUSION CORP	-	CFN US	美国证券交 易所	美国	159.00	28,562.69	0.05
386	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	-	MCHP US	美国证券交 易所	美国	139.00	28,473.38	0.05
387	DENBURY RESOURCES INC	-	DNR US	美国证券交 易所	美国	277.00	28,205.55	0.05
388	CAMPBELL SOUP CO	-	CPB US	美国证券交 易所	美国	128.00	28,070.54	0.05
389	TESORO CORP	-	TSO US	美国证券交 易所	美国	101.00	27,964.50	0.05
390	COMPUTER SCIENCES CORP	-	CSC US	美国证券交 易所	美国	111.00	27,942.50	0.05
391	LAM RESEARCH CORP	-	LRCX US	美国证券交 易所	美国	123.00	27,932.70	0.05

392	AVON PRODUCTS INC	-	AVP US	美国证券交易所	美国	309.00	27,890.27	0.05
393	PULTEGROUP INC	-	PHM US	美国证券交易所	美国	243.00	27,737.16	0.05
394	FAMILY DOLLAR STORES	-	FDO US	美国证券交易所	美国	69.00	27,500.89	0.04
395	SCANA CORP	-	SCG US	美国证券交易所	美国	95.00	27,252.67	0.04
396	VERISIGN INC	-	VRSN US	美国证券交易所	美国	111.00	27,084.35	0.04
397	COVENTRY HEALTH CARE INC	-	CVH US	美国证券交易所	美国	96.00	27,050.78	0.04
398	CBRE GROUP INC - A	-	CBG US	美国证券交易所	美国	216.00	27,017.59	0.04
399	HELMERICH & PAYNE	-	HP US	美国证券交易所	美国	76.00	26,755.86	0.04
400	MASCO CORP	-	MAS US	美国证券交易所	美国	255.00	26,702.69	0.04
401	QUANTA SERVICES INC	-	PWR US	美国证券交易所	美国	153.00	26,244.29	0.04
402	DARDEN RESTAURANTS INC	-	DRI US	美国证券交易所	美国	92.00	26,062.45	0.04
403	COMERICA INC	-	CMA US	美国证券交易所	美国	136.00	25,935.48	0.04
404	EXPEDIA INC	-	EXPE US	美国证券交易所	美国	67.00	25,878.35	0.04
405	CINCINNATI FINANCIAL CORP	-	CINF US	美国证券交易所	美国	105.00	25,844.72	0.04
406	UNUM GROUP	-	UNM US	美国证券交易所	美国	197.00	25,780.23	0.04
407	BMC SOFTWARE INC	-	BMC US	美国证券交易所	美国	102.00	25,426.86	0.04
408	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	-	XRAY US	美国证券交易所	美国	102.00	25,394.80	0.04
409	PINNACLE WEST	-	PNW US	美国证券交易所	美国	79.00	25,314.35	0.04

	CAPITAL							
410	HARRIS CORP	-	HRS US	美国证券交易所	美国	82.00	25,234.52	0.04
411	MEADWESTVA CO CORP	-	MWV US	美国证券交易所	美国	125.00	25,039.86	0.04
412	TYSON FOODS INC-CL A	-	TSN US	美国证券交易所	美国	205.00	24,997.43	0.04
413	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	-	JEC US	美国证券交易所	美国	93.00	24,884.36	0.04
414	DR HORTON INC	-	DHI US	美国证券交易所	美国	200.00	24,865.44	0.04
415	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	-	CLF US	美国证券交易所	美国	102.00	24,721.63	0.04
416	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	-	IFF US	美国证券交易所	美国	59.00	24,675.99	0.04
417	HUNTINGTON BANCSHARES INC	-	HBAN US	美国证券交易所	美国	611.00	24,540.41	0.04
418	QEP RESOURCES INC	-	QEP US	美国证券交易所	美国	128.00	24,353.55	0.04
419	CONSTELLATION BRANDS INC-A	-	STZ US	美国证券交易所	美国	109.00	24,246.38	0.04
420	IRON MOUNTAIN INC	-	IRM US	美国证券交易所	美国	120.00	23,419.77	0.04
421	NETFLIX INC	-	NFLX US	美国证券交易所	美国	40.00	23,326.75	0.04
422	HOSPIRA INC	-	HSP US	美国证券交易所	美国	118.00	23,170.36	0.04
423	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	-	SNI US	美国证券交易所	美国	63.00	22,935.54	0.04
424	FOSSIL INC	-	FOSL US	美国证券交易所	美国	39.00	22,822.02	0.04
425	XYLEM INC	-	XYL US	美国证券交易所	美国	133.00	22,654.83	0.04

426	H&R BLOCK INC	-	HRB US	美国证券交 易所	美国	194.00	22,644.02	0.04
427	TORCHMARK CORP	-	TMK US	美国证券交 易所	美国	68.00	22,084.48	0.04
428	WINDSTREAM CORP	-	WIN US	美国证券交 易所	美国	420.00	21,858.45	0.04
429	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	-	DO US	美国证券交 易所	美国	50.00	21,358.13	0.03
430	AGL RESOURCES INC	-	GAS US	美国证券交 易所	美国	85.00	21,354.67	0.03
431	INTERPUBLI C GROUP OF COS INC	-	IPG US	美国证券交 易所	美国	308.00	21,333.99	0.03
432	LEUCADIA NATIONAL CORP	-	LUK US	美国证券交 易所	美国	142.00	21,233.55	0.03
433	SNAP-ON INC	-	SNA US	美国证券交 易所	美国	42.00	20,852.65	0.03
434	TRIPADVISO R INC	-	TRIP US	美国证券交 易所	美国	79.00	20,835.43	0.03
435	PEPCO HOLDINGS INC	-	POM US	美国证券交 易所	美国	164.00	20,214.42	0.03
436	ROBERT HALF INTL INC	-	RHI US	美国证券交 易所	美国	101.00	20,200.47	0.03
437	GARMIN LTD	-	GRMN US	美国证券交 易所	美国	78.00	20,012.78	0.03
438	ELECTRONIC ARTS INC	-	EA US	美国证券交 易所	美国	218.00	19,909.57	0.03
439	URBAN OUTFITTERS INC	-	URBN US	美国证券交 易所	美国	79.00	19,544.39	0.03
440	CINTAS CORP	-	CTAS US	美国证券交 易所	美国	76.00	19,537.85	0.03
441	SAFEWAY INC	-	SWY US	美国证券交 易所	美国	171.00	19,443.50	0.03
442	FRONTIER COMMUNICAT IONS CORP	-	FTR US	美国证券交 易所	美国	713.00	19,181.08	0.03
443	PEOPLE'S UNITED	-	PBCT US	美国证券交 易所	美国	249.00	18,921.93	0.03

	FINANCIAL							
444	NABORS INDUSTRIES LTD	-	NBR US	美国证券交易所	美国	208.00	18,891.70	0.03
445	HORMEL FOODS CORP	-	HRL US	美国证券交易所	美国	96.00	18,832.36	0.03
446	HASBRO INC	-	HAS US	美国证券交易所	美国	83.00	18,728.90	0.03
447	GANNETT CO	-	GCI US	美国证券交易所	美国	164.00	18,565.10	0.03
448	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	-	TEG US	美国证券交易所	美国	56.00	18,380.81	0.03
449	ZIONS BANCORPORATION	-	ZION US	美国证券交易所	美国	132.00	17,755.28	0.03
450	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	-	AIV US	美国证券交易所	美国	104.00	17,688.91	0.03
451	LSI CORP	-	LSI US	美国证券交易所	美国	395.00	17,578.03	0.03
452	ROWAN COMPANIES PLC-A	-	RDC US	美国证券交易所	美国	89.00	17,492.74	0.03
453	HUDSON CITY BANCORP INC	-	HCBK US	美国证券交易所	美国	340.00	17,374.38	0.03
454	LEGETT & PLATT INC	-	LEG US	美国证券交易所	美国	101.00	17,280.22	0.03
455	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	-	ANF US	美国证券交易所	美国	57.00	17,186.38	0.03
456	MOLEX INC	-	MOLX US	美国证券交易所	美国	99.00	17,006.49	0.03
457	INTL GAME TECHNOLOGY	-	IGT US	美国证券交易所	美国	190.00	16,922.45	0.03
458	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	-	GNW US	美国证券交易所	美国	351.00	16,568.64	0.03
459	PERKINELMER INC	-	PKI US	美国证券交易所	美国	82.00	16,359.15	0.03

460	NEWFIELD EXPLORATIO N CO	-	NFX US	美国证券交 易所	美国	97.00	16,327.59	0.03
461	JABIL CIRCUIT INC	-	JBL US	美国证券交 易所	美国	134.00	16,247.14	0.03
462	DUN & BRADSTREET CORP	-	DNB US	美国证券交 易所	美国	32.00	15,819.35	0.03
463	AVERY DENNISON CORP	-	AVY US	美国证券交 易所	美国	72.00	15,803.26	0.03
464	OWENS-ILLI NOIS INC	-	OI US	美国证券交 易所	美国	118.00	15,775.73	0.03
465	BEMIS COMPANY	-	BMS US	美国证券交 易所	美国	74.00	15,563.15	0.03
466	TENET HEALTHCARE CORP	-	THC US	美国证券交 易所	美国	76.00	15,510.85	0.03
467	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	-	TSS US	美国证券交 易所	美国	115.00	15,483.07	0.03
468	UNITED STATES STEEL CORP	-	X US	美国证券交 易所	美国	103.00	15,453.59	0.03
469	TECO ENERGY INC	-	TE US	美国证券交 易所	美国	146.00	15,380.37	0.02
470	SEALED AIR CORP	-	SEE US	美国证券交 易所	美国	139.00	15,298.22	0.02
471	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	-	GT US	美国证券交 易所	美国	175.00	15,190.48	0.02
472	FLIR SYSTEMS INC	-	FLIR US	美国证券交 易所	美国	108.00	15,144.79	0.02
473	ALLEGHENY TECHNOLOGI ES INC	-	ATI US	美国证券交 易所	美国	77.00	14,693.74	0.02
474	CABLEVISIO N SYSTEMS-NY GRP-A	-	CVC US	美国证券交 易所	美国	154.00	14,461.43	0.02
475	SAIC INC	-	SAI US	美国证券交	美国	203.00	14,443.83	0.02

				易所				
476	TERADYNE INC	-	TER US	美国证券交 易所	美国	135.00	14,331.88	0.02
477	BEST BUY CO INC	-	BBY US	美国证券交 易所	美国	191.00	14,226.29	0.02
478	JDS UNIPHASE CORP	-	JDSU US	美国证券交 易所	美国	167.00	14,212.65	0.02
479	METROPCS COMMUNICAT IONS INC	-	PCS US	美国证券交 易所	美国	227.00	14,182.48	0.02
480	DEAN FOODS CO	-	DF US	美国证券交 易所	美国	133.00	13,801.89	0.02
481	HARMAN INTERNATIO NAL	-	HAR US	美国证券交 易所	美国	49.00	13,748.65	0.02
482	GAMESTOP CORP-CLASS A	-	GME US	美国证券交 易所	美国	87.00	13,720.18	0.02
483	LEGG MASON INC	-	LM US	美国证券交 易所	美国	84.00	13,579.70	0.02
484	WPX ENERGY INC	-	WPX US	美国证券交 易所	美国	143.00	13,374.54	0.02
485	NASDAQ OMX GROUP/THE	-	NDAQ US	美国证券交 易所	美国	84.00	13,204.83	0.02
486	PATTERSON COS INC	-	PDCO US	美国证券交 易所	美国	60.00	12,909.16	0.02
487	J. C. PENNEY CO INC	-	JCP US	美国证券交 易所	美国	102.00	12,636.49	0.02
488	ASSURANT INC	-	AIZ US	美国证券交 易所	美国	57.00	12,432.09	0.02
489	RYDER SYSTEM INC	-	R US	美国证券交 易所	美国	37.00	11,611.90	0.02
490	FIRST HORIZON NATIONAL CORP	-	FHN US	美国证券交 易所	美国	177.00	11,025.21	0.02
491	E*TRADE FINANCIAL CORP	-	ETFC US	美国证券交 易所	美国	184.00	10,350.96	0.02
492	PITNEY BOWES INC	-	PBI US	美国证券交 易所	美国	144.00	9,630.39	0.02

493	APOLLO GROUP INC-CL A	-	APOL US	美国证券交易所	美国	72.00	9,467.47	0.02
494	FEDERATED INVESTORS INC-CL B	-	FII US	美国证券交易所	美国	67.00	8,519.43	0.01
495	FIRST SOLAR INC	-	FSLR US	美国证券交易所	美国	43.00	8,346.14	0.01
496	BIG LOTS INC	-	BIG US	美国证券交易所	美国	42.00	7,513.18	0.01
497	AUTONATION INC	-	AN US	美国证券交易所	美国	28.00	6,986.96	0.01
498	WASHINGTON POST-CLASS B	-	WPO US	美国证券交易所	美国	3.00	6,886.58	0.01
499	ADVANCED MICRO DEVICES	-	AMD US	美国证券交易所	美国	432.00	6,516.81	0.01

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	APPLE INC	AAPL US	4,950,543.63	8.05
2	EXXON MOBIL CORP	XOM US	3,552,182.26	5.77
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,926,600.08	3.13
4	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	1,905,331.38	3.10
5	CHEVRON CORP	CVX US	1,866,076.99	3.03
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	1,865,154.13	3.03
7	AT&T INC	T US	1,805,845.12	2.94
8	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	1,674,021.04	2.72
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	1,588,045.62	2.58
10	PFIZER INC	PFE US	1,568,403.28	2.55
11	WELLS FARGO & CO	WFC US	1,511,118.03	2.46
12	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	1,440,143.46	2.34
13	COCA-COLA CO/THE	KO US	1,433,024.32	2.33
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	1,360,518.83	2.21
15	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	1,329,577.65	2.16
16	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,253,172.58	2.04
17	MERCK & CO. INC.	MRK US	1,181,087.69	1.92

18	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	1, 119, 556. 30	1. 82
19	WAL-MART STORES INC	WMT US	1, 093, 729. 44	1. 78
20	INTEL CORP	INTC US	1, 064, 722. 24	1. 73

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

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	APPLE INC	AAPL US	2, 429, 506. 27	3. 95
2	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1, 786, 939. 07	2. 90
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	985, 564. 86	1. 60
4	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	967, 263. 60	1. 57
5	MICROSOFT CORP	MSFT US	946, 865. 38	1. 54
6	CHEVRON CORP	CVX US	942, 623. 62	1. 53
7	AT&T INC	T US	929, 417. 71	1. 51
8	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	812, 622. 92	1. 32
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	797, 218. 15	1. 30
10	PFIZER INC	PFE US	793, 413. 82	1. 29
11	WELLS FARGO & CO	WFC US	782, 738. 34	1. 27
12	COCA-COLA CO/THE	KO US	779, 716. 53	1. 27
13	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	725, 095. 35	1. 18
14	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	665, 449. 39	1. 08
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	662, 930. 48	1. 08
16	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	629, 656. 46	1. 02
17	MERCK & CO. INC.	MRK US	578, 365. 73	0. 94
18	WAL-MART STORES INC	WMT US	539, 622. 88	0. 88
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	538, 122. 80	0. 87
20	INTEL CORP	INTC US	534, 029. 55	0. 87

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	108, 384, 471. 51
卖出收入（成交）总额	54, 772, 435. 97

注：本项的“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.9 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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Mar13	-8,799.70	-0.01

注：期货投资采用当日无负债结算制度，其公允价值与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵销后的净额为0。具体投资情况可参见8.1报告期末基金资产组合情况下的备注。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

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

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

8.11.3 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	219,992.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	60,797.95
4	应收利息	763.11
5	应收申购款	554,458.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	836,011.70

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 报告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不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,143	28,261.64	2,123,967.95	3.51%	58,440,716.21	96.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	37,368.02	0.06%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年7月27日)基金份额总额	310,182,625.61
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	77,364,414.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	326,982,356.11
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	60,564,684.16

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1) 基金管理人于 2012 年 8 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨锐先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。2) 基金管理人于 2012 年 9 月 15 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李雪松先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 50,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞士银行有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	100,160,806.86	61.39%	47,038.91	61.82%	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	59,639,696.16	36.55%	27,501.27	36.14%	
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	3,356,404.46	2.06%	1,552.47	2.04%	

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《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[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据本公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时标普 500 指数型证券投资基金 2013 年境外主要市场节假日暂停申购赎回等交易类业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-31

2	关于博时旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-28
3	关于博时旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-28
4	关于博时旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-20
5	关于博时旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-20
6	关于直销网上交易系统工商银行网上支付切换为协议代扣模式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-17
7	关于博时旗下部分基金参加中国银行网银、定投业务及手机银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-30
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-28
9	关于博时旗下部分基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-16
10	关于博时旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-16
11	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 指数型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-15
12	关于博时旗下部分基金增加长量基金销售公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-9
13	关于博时旗下部分基金参加长量基金销售公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-9
14	关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通广发银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-5
15	博时基金管理有限公司关于添利宝业务开通工商银行借记卡的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-5
16	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 指数型证券投资基金 2012 年 10 月 31 日恢复申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-11-1
17	博时基金管理有限公司关于开通直销网上交易添利宝业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-30
18	关于博时旗下部分基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-30
19	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 指数型证券投资基金 2012 年 10 月 29 日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-30
20	关于博时旗下部分基金参加众禄基金销售公司网银申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-30
21	博时标普 500 指数基金增加光大银行为代销机构并参加其定投及网银申购优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-26
22	关于博时旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-18

23	博时旗下部分基金增加中国农业银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-15
24	关于博时公司旗下部分基金增加东海证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-10-11
25	关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国银行、交通银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-21
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-21
27	博时标普 500 指数型证券投资基金 2012 年第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-18
28	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-13
29	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的“11 国债 13”估值方法变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-1
30	博时基金管理有限公司关于和中国银行合作进行直销网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-15
31	博时基金管理有限公司关于直销手机交易和电话交易业务新增使用中国邮政储蓄银行、中国农业银行借记卡和招行 i 理财账户、支付宝基金专户进行支付的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-30
32	关于博时标普 500 指数型证券投资基金开通直销网上交易定期定额申购业务和直销网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-16
33	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 指数型证券投资基金参加部分银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-16
34	博时标普 500 指数型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-12
35	关于博时标普 500 指数型证券投资基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-12
36	博时标普 500 指数型证券投资基金开放转换、定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-12
37	博时标普 500 指数型证券投资基金 2012 年下半年境外主要市场节假日暂停申购赎回等交易类业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-12
38	博时标普 500 指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-15
39	关于博时标普 500 指数型证券投资基金新增部分银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-15
40	关于博时标普 500 指数型证券投资基金新增部分券商为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-15

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准博时标普 500 指数型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时标普 500 指数型证券投资基金合同》
- 12.1.3 《博时标普 500 指数型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 报告期内博时标普 500 指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

2013 年 3 月 26 日