

鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2011 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 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投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	48

§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF) (场内简称:鹏华 500)
基金主代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	1,131,651,423.09 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 4 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内,以实现对中国证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

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	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	程国洪	赵会军
	联系电话	0755-82021186	010-66105799
	电子邮箱	ph@mail.phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	姜建清

2.4 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,336,939.96
本期利润	-90,167,555.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0707
本期加权平均净值利润率	-7.00%
本期基金份额净值增长率	-7.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-50,234,568.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0444
期末基金资产净值	1,081,416,854.47
期末基金份额净值	0.956

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.40%

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) 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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

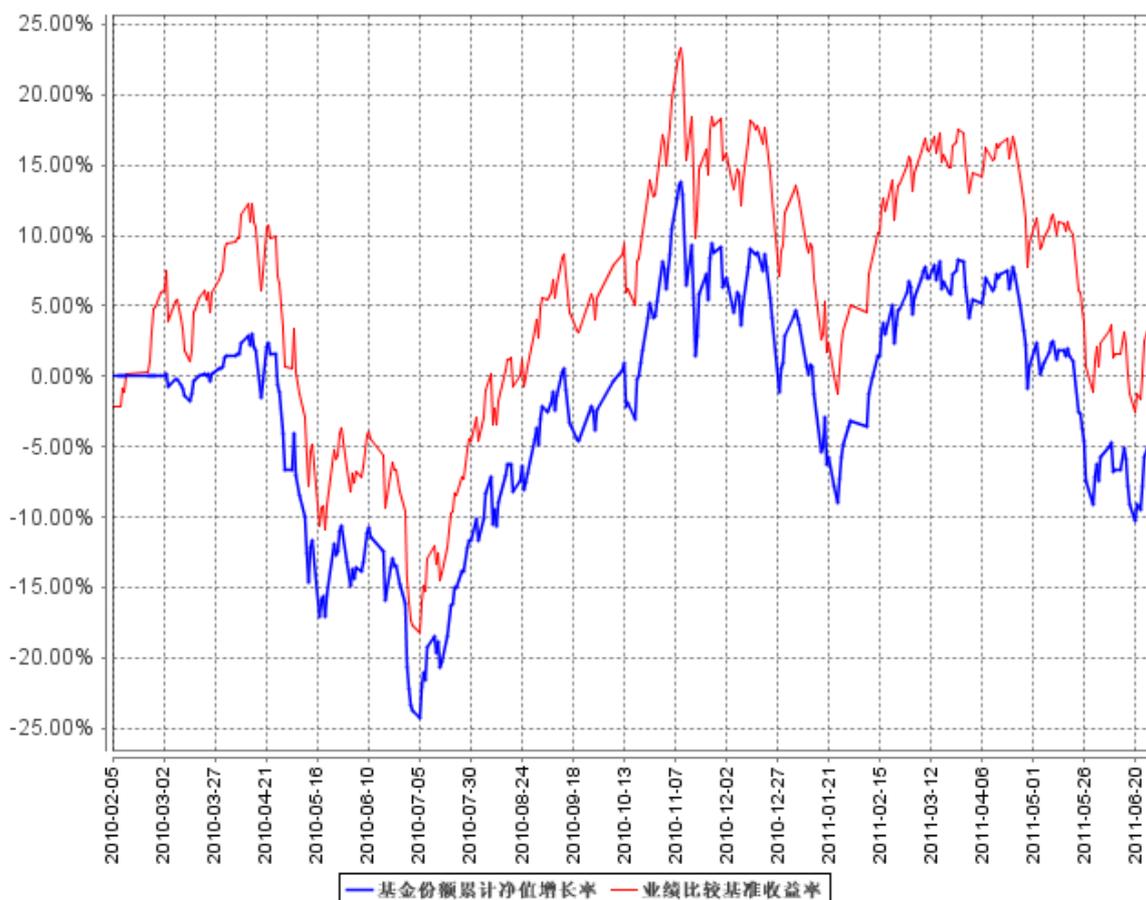
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.91%	1.37%	2.90%	1.37%	0.01%	0.00%
过去三个月	-8.17%	1.34%	-7.98%	1.34%	-0.19%	0.00%
过去六个月	-7.09%	1.37%	-6.82%	1.38%	-0.27%	-0.01%
过去一年	22.88%	1.52%	23.81%	1.53%	-0.93%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.40%	1.55%	3.97%	1.61%	-8.37%	-0.06%

注：本基金业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同于 2010 年 2 月 5 日生效。

2、按基金合同规定，截至建仓期结束本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§ 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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 2 只封闭式基金、21 只开放式基金和 5 只社保组合，经过 12 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
方南	本 基 金 基 金 经 理	2010 年 2 月 5 日	-	9	方南先生, 国籍中国, 工商管理硕士, 9 年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司, 上海新利多数字技术有限公司。2001 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任金融工程部 (原) 研究员、金融工程部 (原) 总经理助理、鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2010 年 2 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2010 年 8 月至今兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注: 1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日; 担任新成立基金基金经理的, 任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地

为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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公平交易制度, 确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金未发生违法违规并对基金财产造成损失的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初, 市场整体上延续了去年 11 月中旬开始的震荡格局, 核心问题还是围绕着货币政策的转向和紧缩与否。期间, 也伴随着出现了一定程度的资产轮动。二季度开始, 持续的紧缩货币政策以及略有下滑的经济数据, 加之低于预期的一季度季报, 共同加速了市场结构特别是中小板、创业板的价值回归。市场整体震荡下行, 估值重心进一步下移, 已经接近近年来的较低水平。

在此期间, 除市场单日波动持续较大外, 同时本基金也面临了一定规模的申赎变动, 对基金的管理运作带来一定影响, 面临这种情况, 我们进行了精心的管理, 较好的实现了跟踪误差控制目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末, 本基金份额净值为 0.956 元, 累计份额净值 0.956 元; 本报告期基金净值增长率为-7.09%, 同期业绩比较基准收益率为-6.82%。

报告期内, 本基金日均跟踪偏离度 0.00%, 年跟踪误差 0.754%, 较好的完成了跟踪目标。

对本基金而言, 本期间跟踪误差的主要来源主要有三个方面: 一是部分成分股长期停牌, 产生一定的权重偏差, 对此, 我们采取了“优化”策略以应对, 取得了较好的效果; 二是本期基金面临了一定的申赎变动, 而当时市场单日波幅较大, 对我们的跟踪管理带来了一定影响; 三是目前的份额净值计算精度 (基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入) 所带来的跟踪误差。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就市场整体估值水平而言, 我们保持前期的观点, 中国 A 股市场整体中枢估值水平较世界其他经济体而言, 考虑预期实际增长率和潜在增长率的话, 并没有高估, 甚至存在相对投资价值。近期市场的关键主要取决于市场对货币政策、经济增长的预期与实际政策和数据之间的修正与博弈。

中短期而言, 我们认为, 随着前期紧缩政策的初见成效, 加上国际大宗商品价格的阶段性回调以及 CPI 数据上的翘尾因素下降等原因, 市场的关注点将从通胀、紧缩转向上市公司的实际盈利增长上来。这才是决定后期行情是否能延续的关键因素。

前期季报中我们曾经提到: 当期公布的经济数据已经初步反映了前期的调控和紧缩政策对尚处在复苏期的经济产生了一定的冷却作用, 这对于尚处在紧缩期的调控决策来说会产生一定程度的反馈, 反而有利于政府更好的调整节奏和方向, 目前股市核心估值水平相对不高, 关键在于经济发展与紧缩之间的不确定性造成的徘徊, 如果政府对节奏和方向进行优化、微调, 那么将使得中国经济摆脱前期较高的波动预期, 进入一个较为平稳的复苏期, 加之通胀预期趋于明朗, 对股市的影响较偏向正面。目前, 我们认为, 市场正在朝这个方向转变, 建议投资者关注这种转变。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击, 努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内, 力争为持有人带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责, 基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体, 独立建账、独立核算, 保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理; 每日按时接收成交数据及权益数据, 进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式, 每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对; 每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外, 还设有基金会计复核岗位, 负责基金会计核算的日常事后复核工作, 确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格, 在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验, 熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定, 本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组, 成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度:

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论, 发表相关意见和建议, 与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末, 本基金可供分配利润为-50,234,568.62元, 期末基金份额净值0.956元, 不符合利润分配条件, 本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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

2011年上半年, 本基金托管人在鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年, 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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, 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)2011年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	56,195,358.25	62,739,475.60
结算备付金		382,207.56	52,374.55
存出保证金		758,564.99	1,070,819.95
交易性金融资产	6.4.7.2	1,025,062,879.51	1,174,094,848.23
其中：股票投资		1,025,062,879.51	1,174,094,848.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		19,231,649.98	17,992,307.03
应收利息	6.4.7.5	14,760.34	13,958.16
应收股利		81,422.18	-
应收申购款		628,554.07	760,763.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,102,355,396.88	1,256,724,547.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		18,126,401.37	12,451,184.84
应付赎回款		1,209,643.94	1,029,217.08
应付管理人报酬		708,677.53	827,624.56
应付托管费		141,735.49	165,524.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	447,164.30	1,088,212.73
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	304,919.78	184,324.20
负债合计		20,938,542.41	15,746,088.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,131,651,423.09	1,206,398,882.34
未分配利润	6.4.7.10	-50,234,568.62	34,579,576.38
所有者权益合计		1,081,416,854.47	1,240,978,458.72
负债和所有者权益总计		1,102,355,396.88	1,256,724,547.04

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.956 元，基金份额总额 1,131,651,423.09 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 2 月 5 日 (基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-82,118,213.64	-531,317,964.88
1. 利息收入		277,785.64	3,166,518.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	277,679.75	3,166,219.45
债券利息收入		105.89	298.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		25,483,890.49	-82,870,882.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,995,273.68	-89,692,674.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	33,998.11	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,454,618.70	6,821,792.55
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-108,504,495.86	-452,006,123.42
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	624,606.09	392,522.37
减：二、费用		8,049,342.26	14,650,315.25

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,784,531.59	7,217,233.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	956,906.27	1,443,446.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,951,727.53	5,598,508.77
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	356,176.87	391,126.35
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-90,167,555.90	-545,968,280.13
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-90,167,555.90	-545,968,280.13

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 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)	1,206,398,882.34	34,579,576.38	1,240,978,458.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-90,167,555.90	-90,167,555.90
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)	-74,747,459.25	5,353,410.90	-69,394,048.35
其中: 1. 基金申购款	550,941,294.07	13,803,523.81	564,744,817.88
2. 基金赎回款	-625,688,753.32	-8,450,112.91	-634,138,866.23
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)	1,131,651,423.09	-50,234,568.62	1,081,416,854.47
项目	上年度可比期间 2010 年 2 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2010 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)	2,630,723,634.12	-	2,630,723,634.12
二、本期经营活动产生的基金净	-	-545,968,280.13	-545,968,280.13

值变动数 (本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-285,620,848.95	26,274,140.47	-259,346,708.48
其中: 1. 基金申购款	53,402,538.44	-5,665,654.44	47,736,884.00
2. 基金赎回款	-339,023,387.39	31,939,794.91	-307,083,592.48
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)	2,345,102,785.17	-519,694,139.66	1,825,408,645.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>邓召明</u>	<u>胡湘</u>	<u>刘慧红</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系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[2009]1374 号文《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由基金管理人鹏华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《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元, 经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2010)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额, 其中认购资金利息折合 891,901.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2010]第 129 号文审核同意, 本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股 (投资比例不低于基金资产净值的 90%), 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 为更好的实现投资目标, 本基金将少量投资于非中证 500 成份股、新股 (首次发行或增发等) 以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基

金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半年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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	56,195,358.25
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计	56,195,358.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,049,378,563.68	1,025,062,879.51	-24,315,684.17
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	1,049,378,563.68	1,025,062,879.51	-24,315,684.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金没有买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内没有进行买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,605.54
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	154.80
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	14,760.34

6.4.7.6 其他资产

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金未持有其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	447,164.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	447,164.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,501.24
上市年费	29,752.78
信息披露费	148,767.52
审计费	49,588.57
深交所席位使用费	11,000.00
指数使用费	62,309.67
合计	304,919.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,206,398,882.34	1,206,398,882.34
本期申购	550,941,294.07	550,941,294.07
本期赎回(以“-”号填列)	-625,688,753.32	-625,688,753.32
本期末	1,131,651,423.09	1,131,651,423.09

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	35,323,134.69	-743,558.31	34,579,576.38
本期利润	18,336,939.96	-108,504,495.86	-90,167,555.90
本期基金份额交易产生的变动数	-6,658,966.01	12,012,376.91	5,353,410.90
其中：基金申购款	19,857,407.89	-6,053,884.08	13,803,523.81
基金赎回款	-26,516,373.90	18,066,260.99	-8,450,112.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,001,108.64	-97,235,677.26	-50,234,568.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日

活期存款利息收入	253,417.83
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	9,322.29
申购款利息收入	14,939.63
合计	277,679.75

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	667,546,819.94
减：卖出股票成本总额	646,551,546.26
买卖股票差价收入	20,995,273.68

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券成交总额	237,104.00
减：卖出债券成本总额	203,000.00
减：应收利息总额	105.89
债券投资收益	33,998.11

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期没有发生衍生工具收益的买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,454,618.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,454,618.70

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-108,504,495.86
——股票投资	-108,504,495.86
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-108,504,495.86

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	529,965.62
转换费收入	94,640.47
合计	624,606.09

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,951,727.53
银行间市场交易费用	-
合计	1,951,727.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行划付费	480.50
上市年费	29,752.78
指数使用费	127,587.50
合计	356,176.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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没有发生变化。

6.4.9.2 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
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、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
国信证券股份有限公司 (“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年2月5日(基金合同生效日) 至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国信证券	70,652,722.12	5.61%	261,724,248.98	5.93%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金 2011 年上半年及自 2010 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止会计期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金 2011 年上半年及自 2010 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止会计期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金 2011 年上半年及自 2010 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止会计期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国信证券	60,055.19	5.73%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2010年2月5日(基金合同生效日)至2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

国信证券	222,466.86	6.04%	222,466.86	9.78%
------	------------	-------	------------	-------

注：(1) 佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年2月5日(基金合同生效日) 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,784,531.59	7,217,233.42
其中：支付销售机构的客户维护费	945,422.41	1,558,221.91

注：(1) 支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年2月5日(基金合同生效日) 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	956,906.27	1,443,446.71

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2011 年上半年及自 2010 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止会计期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比报告期(2010年2月5日-2010年6月30日)管理人未投资、持有本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金 2011 年上半年末及 2010 年年末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 2 月 5 日(基金合同生效日) 至 2010 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
中国工商银行	56,195,358.25	253,417.83	102,350,015.01	3,135,013.29

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及 2010 年可比期间未参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 (2011 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票, 也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010 年 12 月 6 日	公告重大事项	36.88	-	-	158,718	5,003,343.20	5,853,519.84	-
600021	上海电力	2011 年 5 月 31 日	公告重大事项	5.76	2011 年 7 月 28 日	6.34	972,858	4,897,100.36	5,603,662.08	-
000759	中百集团	2011 年 4 月 14 日	资产重组	12.32	-	-	403,391	4,694,501.71	4,969,777.12	-
000917	电广传媒	2010 年 12 月 27 日	资产重组	24.40	2011 年 7 月 6 日	26.84	192,116	3,100,549.65	4,687,630.40	-
000975	科学城	2011 年 3 月 21 日	资产重组	9.17	2011 年 7 月 21 日	10.00	278,996	2,011,050.01	2,558,393.32	-
600363	联创光电	2011 年 6 月 30 日	公告重大事项	11.70	2011 年 7 月 8 日	12.10	156,002	1,844,513.03	1,825,223.40	-
000767	漳泽电力	2011 年 6 月 6 日	公告重大事项	5.56	-	-	314,768	1,289,399.80	1,750,110.08	-

000005	世纪星源	2011 年 5 月 3 日	资产重组	3.86	-	-	427,482	2,155,248.05	1,650,080.52	-
600328	兰太实业	2011 年 6 月 22 日	公告重大事项	11.30	2011 年 7 月 6 日	12.43	127,770	1,414,048.71	1,443,801.00	-
002276	万马电缆	2011 年 6 月 9 日	公告重大事项	13.53	2011 年 7 月 1 日	13.08	95,189	1,392,466.65	1,287,907.17	-
000563	陕国投 A	2011 年 6 月 28 日	公告重大事项	11.10	2011 年 7 月 12 日	12.21	113,091	1,359,342.86	1,255,310.10	-
000950	建峰化工	2011 年 2 月 21 日	资产重组	7.78	2011 年 8 月 15 日	7.00	140,626	1,390,189.46	1,094,070.28	-

注：(1)上海家化联合股份有限公司 2010 年度利润分配方案为：向全体股东每 10 股派发现金 2.50 元（含税），股权登记日为 2011 年 4 月 28 日，除权除息日为 2011 年 4 月 29 日。

(2)重庆建峰化工股份有限公司 2010 年度利润分配方案为：向全体股东每 10 股派发现金 1.00 元（含税），股权登记日为 2011 年 4 月 14 日，除权除息日为 2011 年 4 月 15 日。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

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，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各

业务环节合法合规运作进行监督检查, 组织、指导基金管理人内部监察稽核工作, 并可向董事会和中国证监会直接报告; 在公司内部设立独立的监察稽核部, 专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查, 并适时提出整改建议。

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。

6.4.13.2 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的发行人出现违约、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股份有限公司, 与该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, 违约风险可能性很小; 在银行间同业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 2011 年 6 月 30 日, 本基金未持有信用类债券 (2010 年 12 月 31 日: 未持有)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险, 本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能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，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011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	56,195,358.25	-	-	-	56,195,358.25
结算备付金	382,207.56	-	-	-	382,207.56
存出保证金	-	-	-	758,564.99	758,564.99
交易性金融资产	-	-	-	1,025,062,879.51	1,025,062,879.51
应收证券清算款	-	-	-	19,231,649.98	19,231,649.98
应收利息	-	-	-	14,760.34	14,760.34
应收股利	-	-	-	81,422.18	81,422.18
应收申购款	-	-	-	628,554.07	628,554.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,577,565.81	-	-	1,045,777,831.07	1,102,355,396.88

负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,126,401.37	18,126,401.37
应付赎回款	-	-	-	1,209,643.94	1,209,643.94
应付管理人报酬	-	-	-	708,677.53	708,677.53
应付托管费	-	-	-	141,735.49	141,735.49
应付交易费用	-	-	-	447,164.30	447,164.30
其他负债	-	-	-	304,919.78	304,919.78
负债总计	-	-	-	20,938,542.41	20,938,542.41
利率敏感度缺口	56,577,565.81	-	-	1,024,839,288.66	1,081,416,854.47
上年度末 2010 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	62,739,475.60	-	-	-	62,739,475.60
结算备付金	52,374.55	-	-	-	52,374.55
存出保证金	-	-	-	1,070,819.95	1,070,819.95
交易性金融资产	-	-	-	1,174,094,848.23	1,174,094,848.23
应收证券清算款	-	-	-	17,992,307.03	17,992,307.03
应收利息	-	-	-	13,958.16	13,958.16
应收申购款	-	-	-	760,763.52	760,763.52
资产总计	62,791,850.15	-	-	1,193,932,696.89	1,256,724,547.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,451,184.84	12,451,184.84
应付赎回款	-	-	-	1,029,217.08	1,029,217.08
应付管理人报酬	-	-	-	827,624.56	827,624.56
应付托管费	-	-	-	165,524.91	165,524.91
应付交易费用	-	-	-	1,088,212.73	1,088,212.73
其他负债	-	-	-	184,324.20	184,324.20
负债总计	-	-	-	15,746,088.32	15,746,088.32
利率敏感度缺口	62,791,850.15	-	-	1,178,186,608.57	1,240,978,458.72

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者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资（2010 年 12 月 31 日：未持有），因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2010 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	1,025,062,879.51	94.79	1,174,094,848.23	94.61
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,025,062,879.51	94.79	1,174,094,848.23	94.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约 5,390	-
业绩比较基准下降5%	下降约 5,390	-	

注：由于本基金 2010 年运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，上年度末无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

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)。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具为交易性金融资产，其中属于第一层级的余额为 991,083,394.20 元，属于第二层级的余额为 33,979,485.31 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 1,149,974,767.51 元，第二层级 24,120,080.72 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值转入的层级。

(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。

§ 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	1,025,062,879.51	92.99
	其中：股票	1,025,062,879.51	92.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	56,577,565.81	5.13

6	其他各项资产	20,714,951.56	1.88
7	合计	1,102,355,396.88	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	19,797,560.79	1.83
B	采掘业	12,913,351.24	1.19
C	制造业	605,915,618.43	56.03
C0	食品、饮料	42,207,321.75	3.90
C1	纺织、服装、皮毛	29,883,809.89	2.76
C2	木材、家具	6,398,649.92	0.59
C3	造纸、印刷	24,123,740.83	2.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	111,607,504.48	10.32
C5	电子	69,981,460.37	6.47
C6	金属、非金属	87,548,008.20	8.10
C7	机械、设备、仪表	156,718,215.85	14.49
C8	医药、生物制品	64,972,663.11	6.01
C99	其他制造业	12,474,244.03	1.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	43,181,570.68	3.99
E	建筑业	19,443,137.38	1.80
F	交通运输、仓储业	41,665,523.65	3.85
G	信息技术业	57,767,936.20	5.34
H	批发和零售贸易	69,404,561.47	6.42
I	金融、保险业	9,021,966.08	0.83
J	房地产业	58,907,946.87	5.45
K	社会服务业	35,182,672.92	3.25
L	传播与文化产业	16,269,315.60	1.50
M	综合类	35,591,718.20	3.29
	合计	1,025,062,879.51	94.79

7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000581	威孚高科	190,311	7,336,489.05	0.68
2	600160	巨化股份	207,890	6,748,109.40	0.62
3	600315	上海家化	158,718	5,853,519.84	0.54
4	000877	天山股份	161,682	5,746,178.28	0.53
5	600021	上海电力	972,858	5,603,662.08	0.52
6	002008	大族激光	436,299	5,445,011.52	0.50
7	000759	中百集团	403,391	4,969,777.12	0.46
8	002123	荣信股份	210,547	4,796,260.66	0.44
9	000400	许继电气	154,850	4,770,928.50	0.44
10	000540	中天城投	286,193	4,767,975.38	0.44
11	600311	荣华实业	347,570	4,688,719.30	0.43
12	000917	电广传媒	192,116	4,687,630.40	0.43
13	600176	中国玻纤	153,625	4,642,547.50	0.43
14	600079	人福医药	206,137	4,547,382.22	0.42
15	002038	双鹭药业	119,278	4,502,744.50	0.42
16	600643	爱建股份	428,407	4,498,273.50	0.42
17	600805	悦达投资	296,219	4,443,285.00	0.41
18	000939	凯迪电力	344,811	4,427,373.24	0.41
19	600770	综艺股份	230,724	4,365,298.08	0.40
20	000970	中科三环	207,758	4,298,513.02	0.40
21	600425	青松建化	201,742	4,200,268.44	0.39
22	600499	科达机电	253,610	4,060,296.10	0.38
23	600259	广晟有色	54,400	3,966,848.00	0.37
24	600072	中船股份	149,899	3,897,374.00	0.36
25	000762	西藏矿业	115,989	3,848,515.02	0.36
26	600570	恒生电子	255,416	3,790,373.44	0.35
27	000541	佛山照明	275,370	3,734,017.20	0.35
28	600110	中科英华	581,448	3,732,896.16	0.35
29	600584	长电科技	445,498	3,679,813.48	0.34
30	600586	金晶科技	445,755	3,673,021.20	0.34
31	000636	风华高科	350,372	3,664,891.12	0.34
32	600458	时代新材	189,105	3,638,380.20	0.34
33	600801	华新水泥	141,996	3,635,097.60	0.34
34	600720	祁连山	198,391	3,618,651.84	0.33
35	000926	福星股份	297,588	3,562,128.36	0.33
36	000816	江淮动力	454,850	3,556,927.00	0.33

37	600747	大连控股	435,902	3,526,447.18	0.33
38	000503	海虹控股	375,485	3,439,442.60	0.32
39	600601	方正科技	958,200	3,430,356.00	0.32
40	002022	科华生物	257,062	3,403,500.88	0.31
41	000973	佛塑科技	255,896	3,398,298.88	0.31
42	002292	奥飞动漫	178,853	3,398,207.00	0.31
43	000735	罗牛山	459,597	3,281,522.58	0.30
44	600816	安信信托	165,992	3,268,382.48	0.30
45	000682	东方电子	510,788	3,263,935.32	0.30
46	000488	晨鸣纸业	465,075	3,260,175.75	0.30
47	600797	浙大网新	439,689	3,236,111.04	0.30
48	000826	桑德环境	129,510	3,228,684.30	0.30
49	600409	三友化工	276,651	3,209,151.60	0.30
50	600880	博瑞传播	228,519	3,208,406.76	0.30
51	600325	华发股份	285,300	3,201,066.00	0.30
52	002065	东华软件	134,796	3,194,665.20	0.30
53	600651	飞乐音响	321,611	3,180,732.79	0.29
54	600439	瑞贝卡	287,346	3,178,046.76	0.29
55	000751	锌业股份	405,791	3,169,227.71	0.29
56	600251	冠农股份	94,542	3,135,012.72	0.29
57	000930	中粮生化	402,885	3,130,416.45	0.29
58	600844	丹化科技	178,276	3,112,698.96	0.29
59	600522	中天科技	131,294	3,103,790.16	0.29
60	002233	塔牌集团	233,590	3,090,395.70	0.29
61	600330	天通股份	245,980	3,082,129.40	0.29
62	000897	津滨发展	675,620	3,080,827.20	0.28
63	600851	海欣股份	308,387	3,056,115.17	0.28
64	002056	横店东磁	111,200	3,052,440.00	0.28
65	600765	中航重机	203,133	3,046,995.00	0.28
66	600060	海信电器	226,852	3,044,353.84	0.28
67	002129	中环股份	151,277	3,039,154.93	0.28
68	002097	山河智能	219,555	3,027,663.45	0.28
69	600963	岳阳林纸	352,232	3,015,105.92	0.28
70	600755	厦门国贸	374,204	3,012,342.20	0.28
71	600210	紫江企业	501,800	3,010,800.00	0.28
72	600815	厦工股份	203,578	3,000,739.72	0.28
73	002353	杰瑞股份	45,928	2,980,727.20	0.28
74	000655	金岭矿业	155,440	2,970,458.40	0.27
75	000417	合肥百货	162,899	2,964,761.80	0.27

76	002230	科大讯飞	73,060	2,958,930.00	0.27
77	600783	鲁信创投	116,609	2,957,204.24	0.27
78	600581	八一钢铁	201,533	2,952,458.45	0.27
79	000998	隆平高科	113,443	2,949,518.00	0.27
80	600366	宁波韵升	188,066	2,945,113.56	0.27
81	000659	珠海中富	276,451	2,919,322.56	0.27
82	600069	银鸽投资	301,702	2,902,373.24	0.27
83	600112	长征电气	132,951	2,890,354.74	0.27
84	600326	西藏天路	200,020	2,888,288.80	0.27
85	000571	新大洲 A	387,087	2,879,927.28	0.27
86	000683	远兴能源	320,756	2,870,766.20	0.27
87	600138	中青旅	216,892	2,862,974.40	0.26
88	600820	隧道股份	268,126	2,860,904.42	0.26
89	601002	晋亿实业	154,248	2,852,045.52	0.26
90	600199	金种子酒	169,701	2,840,794.74	0.26
91	600704	物产中大	160,533	2,838,223.44	0.26
92	000510	金路集团	318,109	2,831,170.10	0.26
93	600426	华鲁恒升	165,991	2,805,247.90	0.26
94	600872	中炬高新	415,996	2,795,493.12	0.26
95	600141	兴发集团	133,595	2,786,791.70	0.26
96	000962	东方钨业	111,665	2,786,041.75	0.26
97	000594	国恒铁路	703,605	2,772,203.70	0.26
98	600637	广电信息	222,097	2,765,107.65	0.26
99	002236	大华股份	60,744	2,751,095.76	0.25
100	000963	华东医药	113,331	2,750,543.37	0.25
101	000616	亿城股份	622,379	2,744,691.39	0.25
102	600884	杉杉股份	150,182	2,743,825.14	0.25
103	000501	鄂武商 A	158,928	2,714,490.24	0.25
104	600410	华胜天成	180,300	2,697,288.00	0.25
105	600416	湘电股份	222,421	2,693,518.31	0.25
106	600408	安泰集团	368,019	2,686,538.70	0.25
107	000830	鲁西化工	382,468	2,677,276.00	0.25
108	600888	新疆众和	110,305	2,674,896.25	0.25
109	600787	中储股份	256,200	2,674,728.00	0.25
110	600654	飞乐股份	394,276	2,669,248.52	0.25
111	600594	益佰制药	144,456	2,656,545.84	0.25
112	600673	东阳光铝	165,746	2,653,593.46	0.25
113	600298	安琪酵母	79,907	2,652,912.40	0.25
114	600685	广船国际	88,062	2,645,382.48	0.24

115	600236	桂冠电力	476,332	2,634,115.96	0.24
116	600064	南京高科	188,695	2,613,425.75	0.24
117	600496	精工钢构	207,366	2,610,737.94	0.24
118	000078	海王生物	272,588	2,605,941.28	0.24
119	002430	杭氧股份	116,233	2,602,456.87	0.24
120	000988	华工科技	139,599	2,599,333.38	0.24
121	600022	济南钢铁	544,800	2,598,696.00	0.24
122	600545	新疆城建	282,311	2,591,614.98	0.24
123	600339	天利高新	211,335	2,569,833.60	0.24
124	600351	亚宝药业	330,521	2,568,148.17	0.24
125	600482	风帆股份	168,511	2,564,737.42	0.24
126	000975	科学城	278,996	2,558,393.32	0.24
127	002254	烟台氨纶	143,128	2,553,403.52	0.24
128	601588	北辰实业	696,700	2,549,922.00	0.24
129	600702	沱牌曲酒	123,294	2,547,254.04	0.24
130	002161	远望谷	112,757	2,529,139.51	0.23
131	000726	鲁泰 A	230,663	2,525,759.85	0.23
132	002051	中工国际	92,051	2,522,197.40	0.23
133	600240	华业地产	235,769	2,510,939.85	0.23
134	600227	赤天化	397,029	2,509,223.28	0.23
135	000522	白云山 A	172,668	2,503,686.00	0.23
136	600067	冠城大通	268,851	2,500,314.30	0.23
137	600596	新安股份	237,100	2,494,292.00	0.23
138	600835	上海机电	210,574	2,491,090.42	0.23
139	600449	赛马实业	71,328	2,490,060.48	0.23
140	600295	鄂尔多斯	127,832	2,465,879.28	0.23
141	000066	长城电脑	345,584	2,453,646.40	0.23
142	600322	天房发展	461,909	2,452,736.79	0.23
143	002344	海宁皮城	112,249	2,452,640.65	0.23
144	000627	天茂集团	554,386	2,444,842.26	0.23
145	600388	龙净环保	89,319	2,441,088.27	0.23
146	000159	国际实业	175,872	2,435,827.20	0.23
147	600478	科力远	115,078	2,418,939.56	0.22
148	600435	中兵光电	194,427	2,418,671.88	0.22
149	000997	新大陆	159,874	2,401,307.48	0.22
150	002277	友阿股份	109,409	2,398,245.28	0.22
151	000786	北新建材	150,169	2,389,188.79	0.22
152	600017	日照港	574,200	2,388,672.00	0.22
153	000537	广宇发展	308,113	2,387,875.75	0.22

154	600750	江中药业	97,487	2,386,481.76	0.22
155	600117	西宁特钢	232,234	2,385,043.18	0.22
156	600308	华泰股份	237,101	2,378,123.03	0.22
157	600867	通化东宝	283,731	2,377,665.78	0.22
158	600866	星湖科技	229,928	2,372,856.96	0.22
159	600773	西藏城投	100,400	2,369,440.00	0.22
160	000860	顺鑫农业	137,401	2,368,793.24	0.22
161	600284	浦东建设	144,542	2,366,152.54	0.22
162	600978	宜华木业	421,337	2,363,700.57	0.22
163	600467	好当家	198,516	2,362,340.40	0.22
164	600038	哈飞股份	88,080	2,357,901.60	0.22
165	000650	仁和药业	165,000	2,347,950.00	0.22
166	000823	超声电子	160,994	2,340,852.76	0.22
167	000667	名流置业	782,200	2,338,778.00	0.22
168	000717	韶钢松山	610,267	2,337,322.61	0.22
169	002408	齐翔腾达	73,191	2,329,669.53	0.22
170	000850	华茂股份	295,664	2,326,875.68	0.22
171	600961	株冶集团	137,716	2,321,891.76	0.21
172	600761	安徽合力	156,574	2,318,860.94	0.21
173	600195	中牧股份	101,827	2,316,564.25	0.21
174	000601	韶能股份	483,314	2,310,240.92	0.21
175	002083	孚日股份	286,168	2,309,375.76	0.21
176	001696	宗申动力	319,911	2,300,160.09	0.21
177	600531	豫光金铅	92,506	2,293,223.74	0.21
178	600877	中国嘉陵	281,503	2,285,804.36	0.21
179	000554	泰山石油	200,852	2,283,687.24	0.21
180	000698	沈阳化工	241,591	2,283,034.95	0.21
181	600198	大唐电信	160,464	2,280,193.44	0.21
182	600511	国药股份	150,015	2,277,227.70	0.21
183	600107	美尔雅	150,391	2,243,833.72	0.21
184	002078	太阳纸业	209,881	2,226,837.41	0.21
185	600122	宏图高科	354,919	2,225,342.13	0.21
186	600158	中体产业	352,472	2,220,573.60	0.21
187	002064	华峰氨纶	231,351	2,211,715.56	0.20
188	600509	天富热电	205,439	2,208,469.25	0.20
189	002250	联化科技	69,300	2,207,205.00	0.20
190	600662	强生控股	330,033	2,204,620.44	0.20
191	600628	新世界	222,160	2,201,605.60	0.20
192	600831	广电网络	205,955	2,199,599.40	0.20

193	600127	金健米业	275,159	2,184,762.46	0.20
194	600086	东方金钰	110,375	2,176,595.00	0.20
195	600557	康缘药业	154,710	2,167,487.10	0.20
196	002011	盾安环境	155,556	2,160,672.84	0.20
197	600468	百利电气	79,406	2,160,637.26	0.20
198	600858	银座股份	105,612	2,158,709.28	0.20
199	600289	亿阳信通	241,284	2,157,078.96	0.20
200	600087	长航油运	740,900	2,156,019.00	0.20
201	600723	西单商场	171,570	2,153,203.50	0.20
202	600387	海越股份	161,294	2,138,758.44	0.20
203	002140	东华科技	77,800	2,135,610.00	0.20
204	002048	宁波华翔	177,693	2,126,985.21	0.20
205	600995	文山电力	195,956	2,102,607.88	0.19
206	000006	深振业 A	361,515	2,100,402.15	0.19
207	600139	西部资源	86,674	2,090,576.88	0.19
208	600078	澄星股份	204,355	2,090,551.65	0.19
209	600736	苏州高新	331,449	2,088,128.70	0.19
210	600059	古越龙山	198,909	2,084,566.32	0.19
211	600790	轻纺城	258,495	2,075,714.85	0.19
212	600589	广东榕泰	219,952	2,069,748.32	0.19
213	600580	卧龙电气	251,388	2,066,409.36	0.19
214	000887	中鼎股份	155,554	2,017,535.38	0.19
215	000426	富龙热电	119,271	2,015,679.90	0.19
216	600171	上海贝岭	281,485	2,012,617.75	0.19
217	000088	盐田港	312,061	2,003,431.62	0.19
218	600521	华海药业	140,627	1,994,090.86	0.18
219	000900	现代投资	121,900	1,986,970.00	0.18
220	000886	海南高速	413,085	1,986,938.85	0.18
221	600290	华仪电气	137,566	1,983,701.72	0.18
222	000987	广州友谊	94,385	1,981,141.15	0.18
223	600993	马应龙	103,888	1,975,949.76	0.18
224	000089	深圳机场	353,052	1,952,377.56	0.18
225	000837	秦川发展	145,677	1,947,701.49	0.18
226	600332	广州药业	123,445	1,941,789.85	0.18
227	600491	龙元建设	296,896	1,941,699.84	0.18
228	600033	福建高速	599,000	1,940,760.00	0.18
229	000090	深天健	166,916	1,927,879.80	0.18
230	600436	片仔癀	30,500	1,918,450.00	0.18
231	600641	万业企业	210,484	1,915,404.40	0.18

232	600231	凌钢股份	209,921	1,914,479.52	0.18
233	600707	彩虹股份	153,891	1,914,404.04	0.18
234	000936	华西村	236,022	1,911,778.20	0.18
235	600810	神马股份	115,477	1,898,441.88	0.18
236	600337	美克股份	165,190	1,898,033.10	0.18
237	000755	山西三维	171,532	1,895,428.60	0.18
238	002179	中航光电	83,890	1,887,525.00	0.17
239	000028	一致药业	73,084	1,887,028.88	0.17
240	600618	氯碱化工	117,467	1,882,996.01	0.17
241	600525	长园集团	225,458	1,878,065.14	0.17
242	000410	沈阳机床	170,904	1,873,107.84	0.17
243	600611	大众交通	272,900	1,872,094.00	0.17
244	600569	安阳钢铁	499,984	1,849,940.80	0.17
245	600103	青山纸业	443,587	1,849,757.79	0.17
246	000407	胜利股份	339,023	1,840,894.89	0.17
247	600261	阳光照明	97,820	1,832,168.60	0.17
248	600361	华联综超	208,607	1,831,569.46	0.17
249	000931	中关村	246,679	1,830,358.18	0.17
250	000861	海印股份	102,806	1,827,890.68	0.17
251	600363	联创光电	156,002	1,825,223.40	0.17
252	601678	滨化股份	103,393	1,824,886.45	0.17
253	000598	兴蓉投资	100,600	1,820,860.00	0.17
254	000596	古井贡酒	22,890	1,819,297.20	0.17
255	000301	东方市场	445,306	1,816,848.48	0.17
256	600602	广电电子	275,583	1,816,091.97	0.17
257	600710	常林股份	167,175	1,808,833.50	0.17
258	000996	中国中期	96,083	1,806,360.40	0.17
259	000708	大冶特钢	117,338	1,796,444.78	0.17
260	600838	上海九百	209,337	1,791,924.72	0.17
261	600622	嘉宝集团	214,851	1,785,411.81	0.17
262	600616	金枫酒业	160,349	1,783,080.88	0.16
263	002091	江苏国泰	93,994	1,772,726.84	0.16
264	000799	酒鬼酒	94,950	1,766,070.00	0.16
265	600529	山东药玻	134,401	1,753,933.05	0.16
266	000767	漳泽电力	314,768	1,750,110.08	0.16
267	600291	西水股份	140,364	1,748,935.44	0.16
268	600360	华微电子	283,269	1,747,769.73	0.16
269	600487	亨通光电	64,881	1,742,054.85	0.16
270	600789	鲁抗医药	212,585	1,741,071.15	0.16

271	000903	云内动力	248,840	1,734,414.80	0.16
272	600121	郑州煤电	164,265	1,729,710.45	0.16
273	600644	乐山电力	119,339	1,725,641.94	0.16
274	600590	泰豪科技	166,436	1,724,276.96	0.16
275	000099	中信海直	160,918	1,721,822.60	0.16
276	600223	鲁商置业	209,078	1,714,439.60	0.16
277	600991	广汽长丰	108,797	1,708,112.90	0.16
278	600106	重庆路桥	189,605	1,706,445.00	0.16
279	600268	国电南自	132,688	1,698,406.40	0.16
280	600533	栖霞建设	328,980	1,681,087.80	0.16
281	600575	芜湖港	182,700	1,677,186.00	0.16
282	000777	中核科技	64,909	1,675,301.29	0.15
283	600056	中国医药	64,951	1,673,137.76	0.15
284	600317	营口港	286,571	1,662,111.80	0.15
285	600293	三峡新材	125,927	1,650,902.97	0.15
286	000005	世纪星源	427,482	1,650,080.52	0.15
287	600507	方大特钢	271,650	1,646,199.00	0.15
288	600683	京投银泰	193,413	1,636,273.98	0.15
289	000511	银基发展	482,434	1,635,451.26	0.15
290	000525	红太阳	117,070	1,634,297.20	0.15
291	600780	通宝能源	239,477	1,628,443.60	0.15
292	600754	锦江股份	93,418	1,626,407.38	0.15
293	000050	深天马 A	149,930	1,625,241.20	0.15
294	600510	黑牡丹	166,165	1,625,093.70	0.15
295	600292	九龙电力	104,803	1,624,446.50	0.15
296	600824	益民集团	267,557	1,624,070.99	0.15
297	600282	南钢股份	404,776	1,623,151.76	0.15
298	002237	恒邦股份	40,020	1,618,008.60	0.15
299	600288	大恒科技	159,665	1,617,406.45	0.15
300	600075	新疆天业	137,417	1,617,398.09	0.15
301	000911	南宁糖业	89,808	1,616,544.00	0.15
302	600830	香溢融通	166,070	1,614,200.40	0.15
303	600864	哈投股份	171,188	1,609,167.20	0.15
304	002121	科陆电子	103,574	1,598,146.82	0.15
305	000533	万家乐	216,442	1,597,341.96	0.15
306	000513	丽珠集团	57,972	1,592,490.84	0.15
307	600246	万通地产	317,701	1,588,505.00	0.15
308	600846	同济科技	260,995	1,586,849.60	0.15
309	002431	棕榈园林	60,156	1,585,712.16	0.15

310	000875	吉电股份	350,536	1,580,917.36	0.15
311	600323	南海发展	113,239	1,571,757.32	0.15
312	002223	鱼跃医疗	64,061	1,571,416.33	0.15
313	600270	外运发展	189,133	1,567,912.57	0.14
314	000949	新乡化纤	199,851	1,558,837.80	0.14
315	600827	友谊股份	91,612	1,550,991.16	0.14
316	600693	东百集团	179,227	1,548,521.28	0.14
317	600480	凌云股份	113,330	1,546,954.50	0.14
318	600460	士兰微	90,669	1,540,466.31	0.14
319	000972	新中基	176,206	1,532,992.20	0.14
320	600782	新钢股份	218,291	1,530,219.91	0.14
321	600327	大东方	163,459	1,529,976.24	0.14
322	600006	东风汽车	349,200	1,529,496.00	0.14
323	000712	锦龙股份	111,350	1,526,608.50	0.14
324	000848	承德露露	95,500	1,524,180.00	0.14
325	600475	华光股份	80,208	1,523,149.92	0.14
326	002041	登海种业	73,524	1,519,741.08	0.14
327	600555	九龙山	305,011	1,518,954.78	0.14
328	600082	海泰发展	269,916	1,500,732.96	0.14
329	600825	新华传媒	218,252	1,499,391.24	0.14
330	002168	深圳惠程	82,600	1,485,974.00	0.14
331	600725	云维股份	160,896	1,483,461.12	0.14
332	600676	交运股份	229,157	1,473,479.51	0.14
333	002410	广联达	42,297	1,468,551.84	0.14
334	002311	海大集团	91,237	1,464,353.85	0.14
335	000016	深康佳 A	333,490	1,464,021.10	0.14
336	002309	中利科技	58,611	1,462,344.45	0.14
337	600398	凯诺科技	270,120	1,455,946.80	0.13
338	600597	光明乳业	183,100	1,451,983.00	0.13
339	600197	伊力特	115,143	1,450,801.80	0.13
340	600667	太极实业	171,368	1,449,773.28	0.13
341	600328	兰太实业	127,770	1,443,801.00	0.13
342	600523	贵航股份	75,402	1,436,408.10	0.13
343	600063	皖维高新	122,213	1,436,002.75	0.13
344	000158	常山股份	225,229	1,434,708.73	0.13
345	600776	东方通信	199,685	1,433,738.30	0.13
346	000713	丰乐种业	93,642	1,431,786.18	0.13
347	002249	大洋电机	67,112	1,426,130.00	0.13
348	600429	三元股份	184,855	1,419,686.40	0.13

349	600061	中纺投资	134,437	1,419,654.72	0.13
350	600543	莫高股份	134,148	1,415,261.40	0.13
351	002308	威创股份	128,491	1,414,685.91	0.13
352	600806	昆明机床	122,251	1,413,221.56	0.13
353	600469	风神股份	117,474	1,413,212.22	0.13
354	600896	中海海盛	242,846	1,408,506.80	0.13
355	600438	通威股份	179,508	1,396,572.24	0.13
356	600226	升华拜克	148,241	1,389,018.17	0.13
357	600686	金龙汽车	161,784	1,388,106.72	0.13
358	000520	长航凤凰	281,867	1,381,148.30	0.13
359	600966	博汇纸业	184,440	1,379,611.20	0.13
360	002181	粤传媒	127,995	1,378,506.15	0.13
361	600874	创业环保	227,096	1,376,201.76	0.13
362	600748	上实发展	189,100	1,369,084.00	0.13
363	002052	同洲电子	125,706	1,367,681.28	0.13
364	600488	天药股份	170,095	1,364,161.90	0.13
365	600120	浙江东方	158,372	1,363,582.92	0.13
366	600329	中新药业	112,648	1,361,914.32	0.13
367	600479	千金药业	111,421	1,359,336.20	0.13
368	600894	广钢股份	159,249	1,356,801.48	0.13
369	600277	亿利能源	94,196	1,348,886.72	0.12
370	601777	力帆股份	124,499	1,334,629.28	0.12
371	002506	超日太阳	68,900	1,329,770.00	0.12
372	600983	合肥三洋	111,289	1,327,677.77	0.12
373	000543	皖能电力	161,463	1,323,996.60	0.12
374	600836	界龙实业	130,992	1,321,709.28	0.12
375	600639	浦东金桥	137,158	1,320,831.54	0.12
376	000572	海马汽车	257,644	1,313,984.40	0.12
377	600563	法拉电子	58,746	1,311,210.72	0.12
378	600501	航天晨光	101,640	1,308,106.80	0.12
379	000733	振华科技	130,904	1,303,803.84	0.12
380	002281	光迅科技	40,356	1,303,498.80	0.12
381	002440	闰土股份	60,078	1,297,084.02	0.12
382	600423	柳化股份	145,975	1,296,258.00	0.12
383	002276	万马电缆	95,189	1,287,907.17	0.12
384	002332	仙琚制药	98,161	1,287,872.32	0.12
385	000428	华天酒店	226,844	1,286,205.48	0.12
386	002465	海格通信	43,399	1,285,912.37	0.12
387	600565	迪马股份	263,184	1,284,337.92	0.12

388	000608	阳光股份	234,958	1,282,870.68	0.12
389	600657	信达地产	199,500	1,270,815.00	0.12
390	600163	福建南纸	263,703	1,268,411.43	0.12
391	600640	中卫国脉	104,796	1,268,031.60	0.12
392	002025	航天电器	103,393	1,264,496.39	0.12
393	000584	友利控股	149,460	1,264,431.60	0.12
394	002342	巨力索具	62,700	1,262,778.00	0.12
395	002482	广田股份	41,800	1,261,942.00	0.12
396	600202	哈空调	140,123	1,261,107.00	0.12
397	000563	陕国投 A	113,091	1,255,310.10	0.12
398	600263	路桥建设	85,249	1,253,160.30	0.12
399	600708	海博股份	182,338	1,247,191.92	0.12
400	002242	九阳股份	99,600	1,245,000.00	0.12
401	000677	山东海龙	270,696	1,237,080.72	0.11
402	002444	巨星科技	79,425	1,231,881.75	0.11
403	002475	立讯精密	34,100	1,229,646.00	0.11
404	002285	世联地产	68,177	1,223,777.15	0.11
405	600420	现代制药	90,151	1,222,447.56	0.11
406	000597	东北制药	87,156	1,219,312.44	0.11
407	000852	江钻股份	83,634	1,216,038.36	0.11
408	600052	浙江广厦	273,144	1,210,027.92	0.11
409	000919	金陵药业	131,592	1,209,330.48	0.11
410	002183	怡亚通	174,229	1,207,406.97	0.11
411	000910	大亚科技	165,273	1,198,229.25	0.11
412	002088	鲁阳股份	83,428	1,191,351.84	0.11
413	002336	人人乐	62,662	1,190,578.00	0.11
414	002326	永太科技	48,111	1,190,266.14	0.11
415	002232	启明信息	106,670	1,186,170.40	0.11
416	000738	中航动控	82,200	1,184,502.00	0.11
417	600178	东安动力	120,647	1,181,134.13	0.11
418	000687	保定天鹅	201,022	1,175,978.70	0.11
419	601801	皖新传媒	79,400	1,156,858.00	0.11
420	600333	长春燃气	120,500	1,148,365.00	0.11
421	600102	莱钢股份	120,700	1,144,236.00	0.11
422	002393	力生制药	28,582	1,143,280.00	0.11
423	600129	太极集团	133,752	1,142,242.08	0.11
424	600826	兰生股份	109,827	1,137,807.72	0.11
425	000514	渝开发	145,656	1,136,116.80	0.11
426	002428	云南锗业	25,579	1,133,661.28	0.10

427	600359	新农开发	83,811	1,131,448.50	0.10
428	000912	泸天化	153,822	1,125,977.04	0.10
429	002191	劲嘉股份	128,686	1,123,428.78	0.10
430	000899	赣能股份	168,844	1,122,812.60	0.10
431	600829	三精制药	90,843	1,119,185.76	0.10
432	002218	拓日新能	76,722	1,107,865.68	0.10
433	002480	新筑股份	36,600	1,096,536.00	0.10
434	600054	黄山旅游	65,869	1,094,742.78	0.10
435	000950	建峰化工	140,626	1,094,070.28	0.10
436	000925	众合机电	62,942	1,087,637.76	0.10
437	000619	海螺型材	112,793	1,087,324.52	0.10
438	000617	石油济柴	60,060	1,081,680.60	0.10
439	000631	顺发恒业	163,786	1,072,798.30	0.10
440	002109	兴化股份	112,291	1,071,256.14	0.10
441	000989	九芝堂	93,244	1,070,441.12	0.10
442	600088	中视传媒	86,532	1,055,690.40	0.10
443	600287	江苏舜天	114,045	1,052,635.35	0.10
444	002062	宏润建设	93,994	1,043,333.40	0.10
445	600650	锦江投资	101,973	1,035,025.95	0.10
446	002437	誉衡药业	43,864	1,026,417.60	0.09
447	002340	格林美	48,579	1,023,073.74	0.09
448	600162	香江控股	200,472	1,016,393.04	0.09
449	600073	上海梅林	93,054	1,015,219.14	0.09
450	002384	东山精密	30,078	1,015,132.50	0.09
451	600759	正和股份	191,140	1,014,953.40	0.09
452	002252	上海莱士	42,610	1,014,118.00	0.09
453	002172	澳洋科技	145,226	1,013,677.48	0.09
454	002386	天原集团	75,159	1,008,633.78	0.09
455	002225	濮耐股份	76,288	989,455.36	0.09
456	600834	申通地铁	99,713	974,196.01	0.09
457	002479	富春环保	56,000	969,360.00	0.09
458	002328	新朋股份	60,029	968,267.77	0.09
459	002194	武汉凡谷	87,082	966,610.20	0.09
460	600012	皖通高速	182,599	964,122.72	0.09
461	600743	华远地产	198,086	962,697.96	0.09
462	000990	诚志股份	93,064	961,351.12	0.09
463	601126	四方股份	52,400	960,492.00	0.09
464	000517	荣安地产	110,841	955,449.42	0.09
465	002267	陕天然气	53,098	953,640.08	0.09

466	002306	湘鄂情	48,753	951,171.03	0.09
467	600168	武汉控股	115,182	945,644.22	0.09
468	000905	厦门港务	134,098	945,390.90	0.09
469	002362	汉王科技	37,300	940,706.00	0.09
470	000893	东凌粮油	46,370	939,456.20	0.09
471	600126	杭钢股份	175,234	939,254.24	0.09
472	002345	潮宏基	35,997	938,801.76	0.09
473	002489	浙江永强	31,300	938,687.00	0.09
474	600386	北巴传媒	105,273	928,507.86	0.09
475	600035	楚天高速	195,978	921,096.60	0.09
476	002414	高德红外	44,353	918,550.63	0.08
477	600897	厦门空港	62,205	915,035.55	0.08
478	000042	深 长 城	50,018	910,827.78	0.08
479	002238	天威视讯	50,193	898,956.63	0.08
480	002287	奇正藏药	42,401	896,781.15	0.08
481	600191	华资实业	126,613	892,621.65	0.08
482	002315	焦点科技	18,407	892,187.29	0.08
483	002429	兆驰股份	49,351	875,486.74	0.08
484	002110	三钢闽光	83,764	857,743.36	0.08
485	600258	首旅股份	48,334	855,995.14	0.08
486	002314	雅致股份	58,052	853,944.92	0.08
487	002449	国星光电	33,681	848,761.20	0.08
488	600230	沧州大化	67,710	824,030.70	0.08
489	002320	海峡股份	51,320	821,120.00	0.08
490	601000	唐山港	104,438	803,128.22	0.07
491	002463	沪电股份	72,400	769,612.00	0.07
492	601999	出版传媒	86,304	755,160.00	0.07
493	000029	深深房 A	139,685	715,187.20	0.07
494	002383	合众思壮	22,558	714,637.44	0.07
495	000883	湖北能源	83,600	668,800.00	0.06
496	000979	中弘地产	88,300	655,186.00	0.06
497	600278	东方创业	62,933	654,503.20	0.06
498	002317	众生药业	28,397	637,512.65	0.06
499	600623	双钱股份	32,004	485,820.72	0.04
500	600648	外高桥	32,930	450,811.70	0.04
501	002534	杭锅股份	14,300	313,456.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002073	软控股份	14,757,370.01	1.19
2	002106	莱宝高科	8,735,839.92	0.70
3	600425	青松建化	8,247,668.32	0.66
4	002238	天威视讯	7,361,466.60	0.59
5	000877	天山股份	7,334,815.41	0.59
6	601992	金隅股份	6,477,846.34	0.52
7	600637	广电信息	5,380,116.04	0.43
8	600021	上海电力	5,040,313.10	0.41
9	600805	悦达投资	4,054,361.24	0.33
10	600259	广晟有色	3,963,818.58	0.32
11	600816	安信信托	3,823,322.00	0.31
12	600176	中国玻纤	3,739,199.61	0.30
13	600553	太行水泥	3,701,548.00	0.30
14	600601	方正科技	3,407,690.03	0.27
15	000581	威孚高科	3,386,367.00	0.27
16	000400	许继电气	3,244,465.21	0.26
17	600325	华发股份	3,220,986.52	0.26
18	600060	海信电器	3,051,134.47	0.25
19	600252	中恒集团	3,037,643.00	0.24
20	600210	紫江企业	3,020,759.43	0.24

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002073	软控股份	22,053,329.49	1.78
2	002106	莱宝高科	15,834,920.40	1.28
3	600252	中恒集团	12,307,365.13	0.99
4	600637	广电信息	9,425,133.58	0.76
5	601992	金隅股份	7,963,662.99	0.64

6	002152	广电运通	7,810,864.81	0.63
7	600425	青松建化	7,056,944.15	0.57
8	002238	天威视讯	6,410,059.49	0.52
9	000877	天山股份	6,026,802.66	0.49
10	002081	金螳螂	5,815,985.80	0.47
11	000400	许继电气	5,055,966.69	0.41
12	000559	万向钱潮	4,863,342.29	0.39
13	600805	悦达投资	4,523,493.90	0.36
14	002241	歌尔声学	4,239,023.63	0.34
15	600971	恒源煤电	4,137,126.43	0.33
16	600866	星湖科技	3,773,055.88	0.30
17	000581	威孚高科	3,705,007.52	0.30
18	600079	人福医药	3,285,974.87	0.26
19	002310	东方园林	3,210,614.40	0.26
20	002008	大族激光	3,041,410.96	0.25

注：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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	606,024,073.40
卖出股票收入（成交）总额	667,546,819.94

注：买入股票成本、卖出股票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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体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、处罚的股票。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 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	758,564.99
2	应收证券清算款	19,231,649.98
3	应收股利	81,422.18
4	应收利息	14,760.34
5	应收申购款	628,554.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,714,951.56

7.9.4 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。

7.9.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	5,853,519.84	0.54	公告重大事项
2	600021	上海电力	5,603,662.08	0.52	公告重大事项
3	000759	中百集团	4,969,777.12	0.46	资产重组

7.9.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.9.7 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，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数(户)	基金份额	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
29,800	37,974.88	222,514,479.49	19.66%	909,136,943.60	80.34%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	高桂英	1,950,260.00	2.52%
2	童金兰	1,300,105.00	1.68%
3	王延安	1,280,252.00	1.65%
4	薛晓京	1,005,030.00	1.30%
5	肖菊华	1,000,070.00	1.29%
6	钟莉莉	1,000,060.00	1.29%
	张雪红	1,000,060.00	1.29%
7	冷利群	800,024.00	1.03%
8	刘克成	714,896.00	0.92%
9	王军	673,000.00	0.87%
10	刘文军	653,172.00	0.84%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	164,998.56	0.0146%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年2月5日)基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	1,206,398,882.34
本报告期基金总申购份额	550,941,294.07
减:本报告期基金总赎回份额	625,688,753.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,131,651,423.09

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动:

经 2011 年 3 月 1 日四届董事会第二十四次会议全票通过, 聘任胡湘为公司副总经理, 高管资格申请时间为 2011 年 3 月 4 日, 批准时间为 2011 年 4 月 27 日, 胡湘具有基金从业资格。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的, 与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

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	
长江证券	1	597,794,149.22	47.43%	485,711.67	46.31%	-
银河证券	1	591,845,871.56	46.96%	503,070.79	47.96%	-
国信证券	1	70,652,722.12	5.61%	60,055.19	5.73%	-

注: 交易单元选择的标准和程序

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构, 使用其交易单元作为基金的专用交易单元, 选择的标准是:

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨
询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性
及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在
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，向中国银河证券股份有限公司、
长江证券股份有限公司及国信证券股份有限公司租用交易单元作为基金专用交易单元，并从 2010
年 2 月开始陆续使用。本报告期内上述交易单元未发生变化。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	237,104.00	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2010 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券 报》、《证券时报》	2011 年 1 月 22 日
2	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券 报》、《证券时报》	2011 年 3 月 18 日
3	鹏华基金管理有限公司关于增加	《中国证券报》、《上海证券	2011 年 3 月 18 日

	天相投资顾问有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	报》、《证券时报》	
4	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2010 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 3 月 29 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中国工商银行个人电子银行基金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》	2011 年 4 月 14 日
6	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 4 月 22 日
7	鹏华基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 4 月 30 日
8	鹏华基金管理有限公司关于新增上海银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 5 月 5 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 5 月 28 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 6 月 10 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金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》	2011 年 6 月 29 日
12	鹏华基金管理有限公司关于在工商银行开通部分基金定期定额投资业务并参与其定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2011 年 6 月 29 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行网上银行、移动银行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》	2011 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二) 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;

(三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2011 年 8 月 25 日