

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：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及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责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 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.....	10
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对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.....	13
§6 半年度财务报表(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.....	17
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合.....	32
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动	46

§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
基金简称	泰达宏利财富大盘指数
基金主代码	162213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 23 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	529,098,010.65 份
基金合同存续期	持续经营

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资策略，紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邢颖	唐州徽
	联系电话	010-66577725	010-66594855
	电子邮箱	irm@mfteda.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 7	北京市西城区复兴门内大街 1

	号英蓝国际金融中心南楼 三层	号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼 三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	刘惠文	肖钢

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.mfcteda.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国 际金融中心南楼三层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7, 526, 829. 11
本期利润	-5, 609, 531. 24
加权平均基金份额本期利润	-0. 0104
本期加权平均净值利润率	-0. 99%
本期基金份额净值增长率	-0. 39%
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	18, 272, 958. 76
期末可供分配基金份额利润	0. 0345
期末基金资产净值	547, 370, 969. 41
期末基金份额净值	1. 035
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	5. 50%

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基金份额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. 对期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

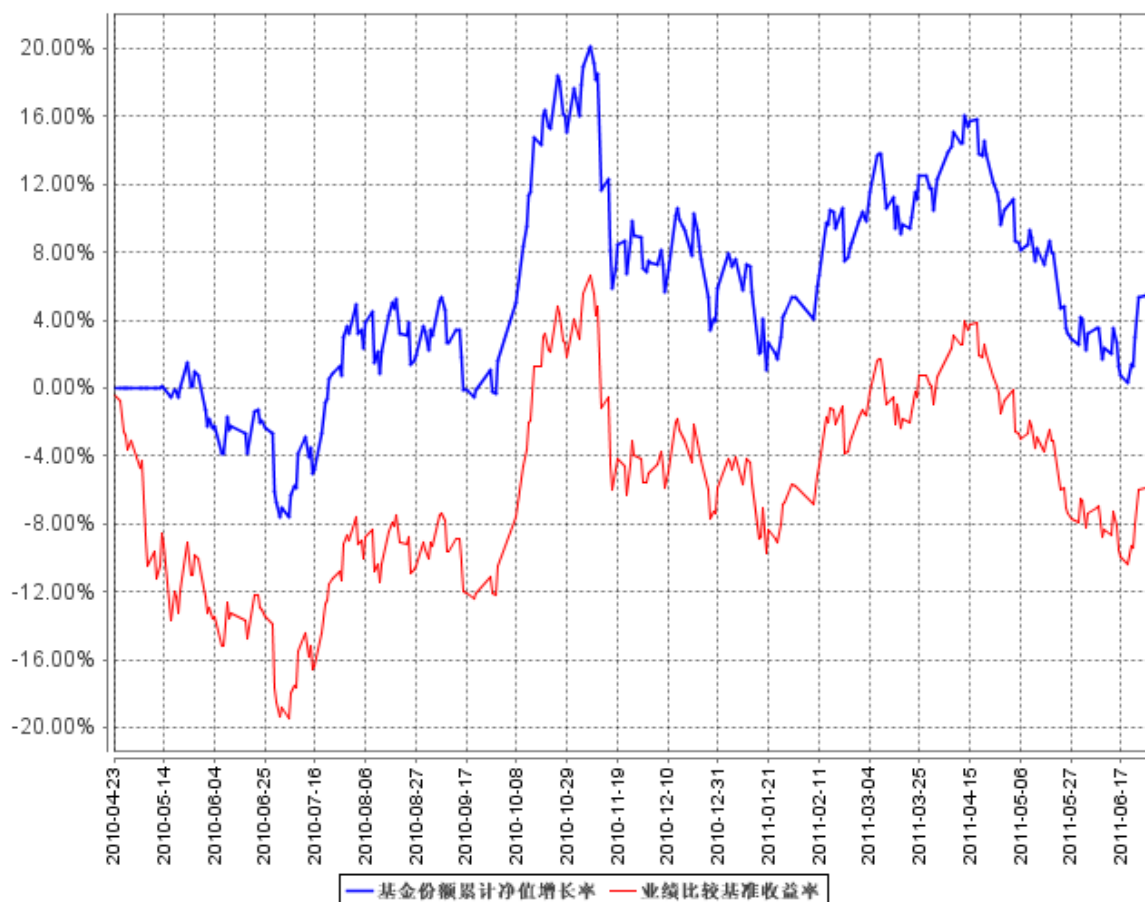
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.27%	1.13%	0.59%	1.14%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-4.52%	1.04%	-5.01%	1.04%	0.49%	0.00%
过去六个月	-0.39%	1.15%	-0.04%	1.15%	-0.35%	0.00%
过去一年	13.08%	1.30%	15.38%	1.30%	-2.30%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.50%	1.25%	-5.94%	1.40%	11.44%	-0.15%

注：本基金业绩比较基准： $95\% \times$ 中证财富大盘指数收益率 $+5\% \times$ 同业存款利率。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选择, 挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本; 此外该指数在加权方式上亦有所创新, 不同于一般的市值加权指数, 该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应, 从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系, 预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落, 提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

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：本基金于 2010 年 4 月 23 日成立，在建仓期结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

§ 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

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配

置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金在内的十五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金经理，国际投资部副总经理	2010年4月23日	-	13	英国牛津大学工程和计算机专业，硕士学历；曾担任伦敦摩根大通（JP Morgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师、汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师、巴克莱国际投资基金管理公司ETF亚洲部门经理、巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门经理。2008年4月加入泰达宏利基金管理有限公司，先后担任金融工程部副总经理、国际投资部副总经理；2010年4月起担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理；具备13年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 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

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，未发生任何利益输送的情况。

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

本基金与公司管理的其他投资组合不具有相似的投资风格。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

A 股市场 2011 年上半年基本上呈震荡小幅上涨的走势，月度 PMI 及核心经济数据，进一步验证了中国经济增速在季节性规律和政府的主动调控政策下出现了放缓。回顾上半年行情，沪综指先上攻 3067 后下探 2610 点遇阻，最终上证指数小跌 0.09%，但中小板综指下跌-12.95%，可以看出上半年是个股严重分化的行情，低估值股补涨，而高估值的中小板股则出现整体下挫。

一季度引发市场分化的主要因素有两个方面，一是通胀迫使政策收紧，前期高估值股估值下调，而低估值股估值上移，二是经济复苏驱动因素走弱。

本基金在 2011 年二季度利用量化投资方法，包括深度的量化研究和准确量化投资选时能力，保持高的风险类股票资产的配置，在市场上涨过程中在很大程度上获得净值提升，同时利用有效

的数量化投资模型来增加了低价股，低估值和高红利的股票权重，从而获得比较不错的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0350 元，本报告期份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准增长率为-0.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

公布的 6 月 PMI 数据看似一般, 主要是因为计入综合 PMI 的分项大部分表现不佳所致。但分项数据中不乏亮点:

下游需求稳定增长, 去库存继续展开, 利润趋势进一步上升, (新订单-产成品库存) 小幅下滑, 这意味着 6 月的工业环比还不会明显反弹,

PMI 中 (新订单-购进价格) 反映中下游加工工业企业的利润趋势, 由于原料价格连续下降, 中下游加工业利润空间明显恢复, 该指标对沪深 300 的季度回报有 1 个季度的领先作用。

投资策略方面, 持续看好大盘股、低价股、低估值和高红利的股票。以创业板为代表的高估值品种面临较大的回归压力, 扩容节奏的加快, 尤其是新三板的推出将加速创业板泡沫的破灭。大盘蓝筹股风险释放充分, 将对稳定市场发挥一定作用。调整充分的房地产股也存在估值修复的机会。本基金未来 6-12 个月的投资策略:

- 中国依然保持结构性增长趋势, 尽管近期政府采取的抗通胀措施会导致经济增长出现有计划的周期性放缓。
- 中国创新势头不减, 生产力保持强劲提升; 虽然劳动力成本不断上升是一个隐忧, 但人均 GDP 增长将推动经济向消费驱动型经济转变。

我们认为 2011 年下半年, 随着中国经济日益受消费驱动 (过去十年主要依靠投资拉动), 消费类商品的前景 (能源、铂金、钾碱和石油) 将比主要靠投资带动的商品 (钢铁、铝和铁矿石) 受益更明显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的 [2008] 38 号文《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, 本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值委员会, 成员由主管基金运营的副总经理、督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员组成。职责分工、专业胜任能力

和相关工作经历具体如下：

主管基金运营的副总经理担任估值委员会主任，督察长、投资总监担任副主任。主要负责估值委员会的组织、管理工作，并对涉及估值委员会的重大事项做出决策。

基金经理：基金经理参与估值委员会的日常工作，主要对长期停牌股票行业类别和重估方法提出建议。参与估值的基金经理具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较为丰富的经验，熟悉相关法律法规和估值方法。

研究部负责人及行业研究员：负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与长期停牌股票行业类别和重估方法的确定。他们具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法律法规和估值方法。

交易部负责人：参与估值委员会的日常工作，主要对长期停牌股票的行业类别和重估方法提出建议。该成员具有多年的股票交易经验，能够较好的对市场的波动及发展趋势作出判断，熟悉相关的法律法规和估值方法。

监察稽核部负责人：负责对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改。该成员具有一定的会计核算估值知识和经验，熟知与估值政策相关的各项法律法规，了解估值原则和估值方法。

金融工程部负责人：负责估值相关数值的处理和计算，确定行业指数，计算估值价格，参与确定估值方法。该成员在金融工程工作方面具有较为丰富的经验，具备应用多种估值模型的专业能力，熟悉相关法律法规和估值方法。

风险管理部负责人：负责估值相关数值的处理和计算，复核由金融工程部提供的行业指数和估值价格。该成员在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，熟悉相关法律法规和估值方法。

基金运营部负责人：参与长期停牌股票估值方法的确定，并与相关托管行进行核对确认，如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。该成员具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉基金估值法律法规、政策和估值方法。

基金经理参与估值委员会对相关停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌股票的基金经理不参与最终的投票表决。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

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

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行收益分配。

§ 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

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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	29,170,195.73	24,905,028.75
结算备付金		980,504.91	6,805,064.71
存出保证金		440,768.28	630,219.46
交易性金融资产	6.4.7.2	516,932,560.21	589,591,595.75
其中：股票投资		516,858,908.71	589,500,657.15

基金投资		-	-
债券投资		73,651.50	90,938.60
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,721.19	23,635.58
应收股利		997,101.03	-
应收申购款		102,786.49	52,310.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		548,631,637.84	622,007,854.89
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		-	-
应付赎回款		85,791.19	172,681.62
应付管理人报酬		301,853.23	366,352.31
应付托管费		55,726.75	67,634.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	226,455.02	1,914,750.59
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	590,842.24	645,072.85
负债合计		1,260,668.43	3,166,491.66
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	529,098,010.65	595,743,595.27
未分配利润	6.4.7.10	18,272,958.76	23,097,767.96
所有者权益合计		547,370,969.41	618,841,363.23
负债和所有者权益总计		548,631,637.84	622,007,854.89

注：报告截至日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.035 元，基金份额总额 529,098,010.65 份。

6.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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4月23日至2010 年6月30日
一、收入		-1,865,317.35	-46,266,353.68
1. 利息收入		120,445.78	1,337,507.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	120,281.18	499,686.25
债券利息收入		164.60	153.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	837,667.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,169,310.00	-6,354,170.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,323,116.42	-9,095,971.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,739.71	18,657.63
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	6,152,066.71	2,723,143.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,917,297.87	-41,784,761.21
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	266,249.00	535,069.74
二、费用		3,744,213.89	2,873,384.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,833,354.03	1,147,330.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	338,465.39	211,814.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,308,443.03	1,392,442.98
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	263,951.44	121,795.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,609,531.24	-49,139,737.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,609,531.24	-49,139,737.84

注：本基金基金合同于 2010 年 4 月 23 日生效，故上年度实际可比较区间为 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

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）	595,743,595.27	23,097,767.96	618,841,363.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,609,531.24	-5,609,531.24
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）	-66,645,584.62	784,722.04	-65,860,862.58
其中：1. 基金申购款	149,650,020.75	11,566,557.81	161,216,578.56
2. 基金赎回款	-216,295,605.37	-10,781,835.77	-227,077,441.14
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）	529,098,010.65	18,272,958.76	547,370,969.41
项目	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 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）	1,165,158,636.81	-	1,165,158,636.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-49,139,737.84	-49,139,737.84
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）	-426,000,408.95	-686,097.91	-426,686,506.86
其中：1. 基金申购款	1,391,575.03	-24,098.09	1,367,476.94
2. 基金赎回款	-427,391,983.98	-661,999.82	-428,053,983.80
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）	739,158,227.86	-49,825,835.75	689,332,392.11

注：本基金基金合同于 2010 年 4 月 23 日生效，故上年度实际可比较区间为 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 6 月 30 日。

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> 缪钧伟 </u>	<u> 傅国庆 </u>	<u> 王泉 </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

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2010】第 176 号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准，由泰达宏利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《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,165,036,951.93 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(2010)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,165,158,636.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 121,684.88 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $\text{中证财富大盘指数收益率} \times 95\% + \text{同业存款利率} \times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2011 年 8 月 25 日批准报出。

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》、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所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。

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 年度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 年度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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无重大会计差错发生。

6.4.6 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[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 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。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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	29,170,195.73
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	29,170,195.73

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	537,738,383.45	516,858,908.71	-20,879,474.74
债券	交易所市场	73,651.50	8,485.63
	银行间市场	-	-
	合计	73,651.50	8,485.63
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	537,803,549.32	516,932,560.21	-20,870,989.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金买入返售金融资产期末无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	5,093.99
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	397.17
应收债券利息	186.35
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2,043.68
其他	-
合计	7,721.19

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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	226,455.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	226,455.02

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	250,000.00
应付赎回费	241.38
预提费用	193,396.69
指数使用费	147,204.17
合计	590,842.24

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	595,743,595.27	595,743,595.27
本期申购	149,650,020.75	149,650,020.75
本期赎回(以“-”号填列)	-216,295,605.37	-216,295,605.37
本期末	529,098,010.65	529,098,010.65

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	30,168,486.24	-7,070,718.28	23,097,767.96
本期利润	-7,526,829.11	1,917,297.87	-5,609,531.24
本期基金份额交易产生的变动数	-3,011,423.27	3,796,145.31	784,722.04
其中：基金申购款	5,939,326.95	5,627,230.86	11,566,557.81
基金赎回款	-8,950,750.22	-1,831,085.55	-10,781,835.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,630,233.86	-1,357,275.10	18,272,958.76

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	109,810.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,042.59
结算备付金利息收入	8,428.24
其他	-
合计	120,281.18

注：其他存款利息收入为直销申购款利息收入。

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	447,204,366.58
减：卖出股票成本总额	457,527,483.00
买卖股票差价收入	-10,323,116.42

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（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,763.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,007.66
减：应收利息总额	15.73
债券投资收益	1,739.71

资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期内本基金无权证差价收入。

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	6,152,066.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,152,066.71

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	1,917,297.87
——股票投资	1,925,750.84
——债券投资	-8,452.97
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,917,297.87

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	189,037.99
转换费收入	77,211.01
合计	266,249.00

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的基金转换费用中的赎回费的 25% 归入基金资产。

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	1,308,443.03
银行间市场交易费用	-
合计	1,308,443.03

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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行费用	5,143.83
银行间账户维护费	9,000.00
指数使用费	56,410.92
合计	263,951.44

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

本基金本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

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

本报告期本基金没有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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

本基金本报告期内未与各关联方发生关联交易。

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

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的股票交易（2010 年上半年同）。

债券交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的债券交易（2010 年上半年同）。

债券回购交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的债券回购交易（2010 年上半年同）。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易（2010 年上半年同）。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期内本基金无应支付关联方的佣金（2010 年上半年同）。

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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 4 月 23 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,833,354.03	1,147,330.42
其中：支付销售机构的客户维护费	100,844.60	166,615.66

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.65% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 4 月 23 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	338,465.39	211,814.84

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.12\% / \text{当年天数}。$$

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

本报告期内本基金未有与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)的交易(2010年上半年同)。

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

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况(2010年上半年同)。

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

本报告期内未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况(2010年年末同)。

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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年4月23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
中国银行股份有限公司	29,170,195.73	109,810.35	152,214,192.56	480,986.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未有在承销期内参与关联方承销证券的情况(2010年上半年同)。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他交易事项的说明(2010年上半年同)。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

本报告期内本基金未持有因认购新股/增发证券而导致流通受限的证券。

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
601998	中信银行	2011年6月29日	配股缴款	4.75	2011年7月7日	4.59	280,465	1,565,626.55	1,332,208.75	-
600216	浙江医药	2011年6月27日	重大事项	31.39	2011年7月4日	32.60	35,416	1,203,485.74	1,111,708.24	-
000876	新希望	2011年6月29日	资产重组	19.95	2011年7月5日	21.95	45,294	836,416.01	903,615.30	-
600098	广州控股	2011年6月20日	重大事项	6.79	2011年7月8日	7.47	98,114	810,727.64	666,194.06	-
600021	上海电力	2011年5月31日	重大事项	5.76	2011年7月28日	6.34	109,667	538,247.00	631,681.92	-
000959	首钢股份	2010年10月29日	重大事项	4.42	-	-	137,475	555,320.38	607,639.50	-
600170	上海建工	2011年6月29日	重大事项	15.59	2011年7月4日	16.25	31,427	472,571.80	489,946.93	-
000759	中百集团	2011年4月14日	重大事项	12.32	-	-	39,214	504,671.84	483,116.48	-

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

本报告期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动

中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核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在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

本公司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银行，因而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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理

人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

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部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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约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。

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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个月 以内	1-3个 月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	29,170,195.73	-	-	-	29,170,195.73
结算备付金	-	-	-	-	-	980,504.91	-	-	-	980,504.91
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	440,768.28	440,768.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	73,651.50	-	-	516,858,908.71	516,932,560.21
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	7,721.19	7,721.19
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	997,101.03	997,101.03
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	102,786.49	102,786.49
资产总计	-	-	-	-	-	30,224,352.14	-	-	518,407,285.70	548,631,637.84
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	85,791.19	85,791.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	301,853.23	301,853.23
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	55,726.75	55,726.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	226,455.02	226,455.02
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	590,842.24	590,842.24
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,260,668.43	1,260,668.43
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	30,224,352.14	-	-	517,146,617.27	547,370,969.41
上年度末 2010年12 月31日	1个月 以内	1-3个 月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产										
银行存款	-	-	-	-	-	24,905,028.75	-	-	-	24,905,028.75
结算备付金	-	-	-	-	-	6,805,064.71	-	-	-	6,805,064.71
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	630,219.46	630,219.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	90,938.60	-	-	589,500,657.15	589,591,595.75
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	23,635.58	23,635.58
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	52,310.64	52,310.64
资产总计	-	-	-	-	-	31,801,032.06	-	-	590,206,822.83	622,007,854.89
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	172,681.62	172,681.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	366,352.31	366,352.31
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	67,634.29	67,634.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	1,914,750.59	1,914,750.59
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	645,072.85	645,072.85
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	3,166,491.66	3,166,491.66
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	31,801,032.06	-	-	587,040,331.17	618,841,363.23

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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%（2010 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

本基金的基金管理人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。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及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，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。

6.4.13.4.2.1 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	516,858,908.71	94.43	589,500,657.15	95.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	516,858,908.71	94.43	589,500,657.15	95.26

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	25,515,697.74	29,870,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-25,515,697.74	-29,870,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期末本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	516,858,908.71	94.21
	其中：股票	516,858,908.71	94.21
2	固定收益投资	73,651.50	0.01
	其中：债券	73,651.50	0.01
	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	30,150,700.64	5.50
6	其他各项资产	1,548,376.99	0.28
7	合计	548,631,637.84	100.00

7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

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	379,358.00	0.07
B	采掘业	55,080,450.01	10.06
C	制造业	153,457,864.46	28.04
C0	食品、饮料	13,577,462.50	2.48
C1	纺织、服装、皮毛	3,639,585.78	0.66
C2	木材、家具	788,314.76	0.14
C3	造纸、印刷	3,366,942.04	0.62
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,593,474.17	2.12
C5	电子	4,030,615.99	0.74
C6	金属、非金属	45,029,110.08	8.23
C7	机械、设备、仪表	60,611,914.87	11.07
C8	医药、生物制品	9,844,970.27	1.80
C99	其他制造业	975,474.00	0.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,474,837.84	3.74

E	建筑业	20,968,172.45	3.83
F	交通运输、仓储业	19,861,900.52	3.63
G	信息技术业	18,131,027.73	3.31
H	批发和零售贸易	12,102,913.37	2.21
I	金融、保险业	165,844,998.77	30.30
J	房地产业	33,090,211.56	6.05
K	社会服务业	4,530,078.66	0.83
L	传播与文化产业	342,312.67	0.06
M	综合类	9,704,851.62	1.77
	合计	513,968,977.66	93.90

7.2.2 积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	940,926.00	0.17
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,488.00	0.01
C5	电子	220,024.00	0.04
C6	金属、非金属	50,578.00	0.01
C7	机械、设备、仪表	320,236.00	0.06
C8	医药、生物制品	318,600.00	0.06
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	255,588.00	0.05
G	信息技术业	1,343,877.25	0.25
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	75,462.80	0.01
J	房地产业	108,667.00	0.02
K	社会服务业	165,410.00	0.03
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,889,931.05	0.53

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	600016	民生银行	3,885,775	22,265,490.75	4.07
2	600036	招商银行	1,307,440	17,022,868.80	3.11
3	601328	交通银行	3,035,427	16,816,265.58	3.07
4	601166	兴业银行	1,116,018	15,043,922.64	2.75
5	600000	浦发银行	1,508,791	14,846,503.44	2.71
6	600050	中国联通	2,306,099	12,107,019.75	2.21
7	601088	中国神华	386,268	11,642,117.52	2.13
8	600030	中信证券	845,841	11,063,600.28	2.02
9	601318	中国平安	226,814	10,948,311.78	2.00
10	601398	工商银行	2,337,266	10,424,206.36	1.90
11	000002	万科A	1,229,376	10,388,227.20	1.90
12	601939	建设银行	1,480,119	7,311,787.86	1.34
13	601668	中国建筑	1,699,067	6,847,240.01	1.25
14	000001	深发展A	381,847	6,518,128.29	1.19
15	600585	海螺水泥	228,592	6,345,713.92	1.16
16	600019	宝钢股份	968,659	5,841,013.77	1.07
17	600028	中国石化	707,537	5,823,029.51	1.06
18	601006	大秦铁路	707,626	5,795,456.94	1.06
19	601169	北京银行	545,955	5,443,171.35	0.99
20	601601	中国太保	239,195	5,355,576.05	0.98
21	000651	格力电器	208,557	4,901,089.50	0.90
22	600048	保利地产	438,441	4,818,466.59	0.88
23	601857	中国石油	438,003	4,769,852.67	0.87
24	600837	海通证券	509,904	4,599,334.08	0.84
25	600519	贵州茅台	20,254	4,306,608.02	0.79
26	600104	上海汽车	215,979	4,047,446.46	0.74
27	600015	华夏银行	351,577	3,821,641.99	0.70
28	000858	五粮液	105,974	3,785,391.28	0.69
29	600031	三一重工	202,361	3,650,592.44	0.67
30	000157	中联重科	229,553	3,530,525.14	0.64
31	000527	美的电器	173,667	3,193,736.13	0.58
32	000709	河北钢铁	706,152	3,191,807.04	0.58
33	600795	国电电力	1,073,810	3,178,477.60	0.58

34	600383	金地集团	491,131	3,148,149.71	0.58
35	601390	中国中铁	783,863	3,127,613.37	0.57
36	000338	潍柴动力	67,561	3,069,296.23	0.56
37	002024	苏宁电器	239,553	3,068,673.93	0.56
38	600900	长江电力	413,190	2,979,099.90	0.54
39	601699	潞安环能	89,958	2,951,521.98	0.54
40	601186	中国铁建	486,270	2,941,933.50	0.54
41	600177	雅戈尔	296,499	2,926,445.13	0.53
42	600011	华能国际	549,273	2,900,161.44	0.53
43	600089	特变电工	210,832	2,728,166.08	0.50
44	000063	中兴通讯	96,208	2,720,762.24	0.50
45	600005	武钢股份	636,956	2,643,367.40	0.48
46	601989	中国重工	186,588	2,573,048.52	0.47
47	600348	国阳新能	102,307	2,469,690.98	0.45
48	000402	金融街	317,818	2,374,100.46	0.43
49	601899	紫金矿业	325,690	2,357,995.60	0.43
50	600642	申能股份	455,850	2,311,159.50	0.42
51	600068	葛洲坝	190,944	2,289,418.56	0.42
52	601628	中国人寿	121,000	2,268,750.00	0.41
53	000983	西山煤电	91,889	2,223,713.80	0.41
54	601898	中煤能源	217,988	2,179,880.00	0.40
55	601009	南京银行	234,855	2,106,649.35	0.38
56	601618	中国中冶	534,026	2,104,062.44	0.38
57	600739	辽宁成大	74,036	2,058,200.80	0.38
58	000623	吉林敖东	63,506	1,956,619.86	0.36
59	000825	太钢不锈	375,002	1,931,260.30	0.35
60	000778	新兴铸管	180,193	1,901,036.15	0.35
61	600881	亚泰集团	228,053	1,899,681.49	0.35
62	600123	兰花科创	44,321	1,851,731.38	0.34
63	601299	中国北车	272,357	1,824,791.90	0.33
64	601766	中国南车	255,637	1,820,135.44	0.33
65	600690	青岛海尔	64,645	1,806,827.75	0.33
66	601788	光大证券	131,186	1,803,807.50	0.33
67	000937	冀中能源	71,135	1,803,272.25	0.33
68	600188	兖州煤业	50,653	1,788,050.90	0.33
69	000568	泸州老窖	39,426	1,778,901.12	0.32
70	600362	江西铜业	49,776	1,764,061.44	0.32
71	600741	华域汽车	157,528	1,753,286.64	0.32
72	601333	广深铁路	425,475	1,748,702.25	0.32

73	000069	华侨城 A	220,128	1,741,212.48	0.32
74	000792	盐湖股份	29,337	1,730,883.00	0.32
75	000898	鞍钢股份	252,010	1,713,668.00	0.31
76	000425	徐工机械	68,848	1,706,741.92	0.31
77	601168	西部矿业	111,549	1,653,156.18	0.30
78	000528	柳 工	72,168	1,633,161.84	0.30
79	601666	平煤股份	116,216	1,628,186.16	0.30
80	000100	TCL 集团	534,368	1,597,760.32	0.29
81	600660	福耀玻璃	148,985	1,543,484.60	0.28
82	600150	中国船舶	20,617	1,525,451.83	0.28
83	000024	招商地产	81,845	1,497,763.50	0.27
84	600196	复星医药	134,578	1,464,208.64	0.27
85	000401	冀东水泥	57,859	1,445,896.41	0.26
86	000039	中集集团	65,530	1,433,796.40	0.26
87	601117	中国化学	161,114	1,427,470.04	0.26
88	000783	长江证券	128,946	1,388,748.42	0.25
89	600808	马钢股份	399,033	1,388,634.84	0.25
90	600153	建发股份	153,172	1,363,230.80	0.25
91	000683	远兴能源	149,103	1,334,471.85	0.24
92	601998	中信银行	280,465	1,332,208.75	0.24
93	000581	威孚高科	32,791	1,264,093.05	0.23
94	601808	中海油服	70,288	1,255,343.68	0.23
95	601001	大同煤业	70,894	1,205,198.00	0.22
96	002001	新 和 成	40,788	1,201,206.60	0.22
97	600169	太原重工	118,018	1,197,882.70	0.22
98	600583	海油工程	185,268	1,189,420.56	0.22
99	600309	烟台万华	62,796	1,174,913.16	0.21
100	000800	一汽轿车	81,380	1,152,340.80	0.21
101	002202	金风科技	77,174	1,152,207.82	0.21
102	000630	铜陵有色	47,146	1,136,218.60	0.21
103	600508	上海能源	45,717	1,114,123.29	0.20
104	600216	浙江医药	35,416	1,111,708.24	0.20
105	600009	上海机场	85,905	1,099,584.00	0.20
106	000932	华菱钢铁	266,349	1,094,694.39	0.20
107	601111	中国国航	113,761	1,090,967.99	0.20
108	600999	招商证券	59,339	1,090,650.82	0.20
109	600166	福田汽车	124,778	1,083,073.04	0.20
110	002142	宁波银行	99,226	1,079,578.88	0.20
111	600415	小商品城	87,578	1,076,333.62	0.20

112	600376	首开股份	80,760	1,066,839.60	0.19
113	600219	南山铝业	113,353	1,066,651.73	0.19
114	000422	湖北宜化	50,920	1,065,755.60	0.19
115	000488	晨鸣纸业	149,630	1,048,906.30	0.19
116	000027	深圳能源	138,928	1,047,517.12	0.19
117	600308	华泰股份	104,080	1,043,922.40	0.19
118	600266	北京城建	68,505	1,031,000.25	0.19
119	601688	华泰证券	83,123	1,026,569.05	0.19
120	000933	神火股份	65,231	992,163.51	0.18
121	600875	东方电气	38,292	976,446.00	0.18
122	600210	紫江企业	162,579	975,474.00	0.18
123	000009	中国宝安	56,408	971,345.76	0.18
124	600320	振华重工	143,999	957,593.35	0.17
125	600325	华发股份	85,302	957,088.44	0.17
126	000895	双汇发展	14,422	952,861.54	0.17
127	000680	山推股份	53,449	940,167.91	0.17
128	000012	南玻A	56,706	935,649.00	0.17
129	600418	江淮汽车	84,188	935,328.68	0.17
130	600269	赣粤高速	194,768	917,357.28	0.17
131	000060	中金岭南	68,883	916,143.90	0.17
132	600839	四川长虹	272,674	910,731.16	0.17
133	000876	新希望	45,294	903,615.30	0.17
134	600500	中化国际	89,633	895,433.67	0.16
135	600518	康美药业	67,975	894,551.00	0.16
136	000900	现代投资	53,742	875,994.60	0.16
137	000616	亿城股份	197,962	873,012.42	0.16
138	000625	长安汽车	94,610	865,681.50	0.16
139	600271	航天信息	33,224	858,508.16	0.16
140	000728	国元证券	74,895	846,313.50	0.15
141	600997	开滦股份	52,725	841,491.00	0.15
142	600066	宇通客车	36,224	838,223.36	0.15
143	600717	天津港	102,023	834,548.14	0.15
144	600366	宁波韵升	53,230	833,581.80	0.15
145	600805	悦达投资	55,233	828,495.00	0.15
146	000839	中信国安	79,296	825,471.36	0.15
147	600649	城投控股	101,132	821,191.84	0.15
148	600675	中华企业	118,689	807,085.20	0.15
149	600811	东方集团	116,914	804,368.32	0.15
150	000926	福星股份	66,863	800,350.11	0.15

151	600395	盘江股份	24,043	797,987.17	0.15
152	000562	宏源证券	47,385	791,803.35	0.14
153	600631	百联股份	52,786	785,455.68	0.14
154	600058	五矿发展	22,911	785,389.08	0.14
155	600029	南方航空	99,095	776,904.80	0.14
156	600970	中材国际	28,086	767,590.38	0.14
157	600547	山东黄金	16,856	755,823.04	0.14
158	600352	浙江龙盛	78,546	752,470.68	0.14
159	600720	祁连山	40,995	747,748.80	0.14
160	601958	金钼股份	38,484	740,817.00	0.14
161	600886	国投电力	102,128	740,428.00	0.14
162	000725	京东方 A	270,263	737,817.99	0.13
163	600018	上港集团	185,440	723,216.00	0.13
164	600820	隧道股份	67,776	723,169.92	0.13
165	600489	中金黄金	26,268	716,853.72	0.13
166	600208	新湖中宝	114,867	715,621.41	0.13
167	600664	哈药股份	45,567	715,401.90	0.13
168	000726	鲁泰 A	65,127	713,140.65	0.13
169	600033	福建高速	218,431	707,716.44	0.13
170	600256	广汇股份	29,506	701,652.68	0.13
171	600449	赛马实业	19,915	695,232.65	0.13
172	000539	粤电力 A	126,693	684,142.20	0.12
173	000717	韶钢松山	175,962	673,934.46	0.12
174	600064	南京高科	48,277	668,636.45	0.12
175	600098	广州控股	98,114	666,194.06	0.12
176	600426	华鲁恒升	39,114	661,026.60	0.12
177	600100	同方股份	63,161	660,664.06	0.12
178	601588	北辰实业	180,374	660,168.84	0.12
179	600742	一汽富维	22,342	654,173.76	0.12
180	600528	中铁二局	74,361	646,197.09	0.12
181	000951	中国重汽	34,909	645,118.32	0.12
182	002073	软控股份	31,209	642,905.40	0.12
183	600895	张江高科	67,570	637,860.80	0.12
184	600755	厦门国贸	78,801	634,348.05	0.12
185	000729	燕京啤酒	37,226	631,725.22	0.12
186	600021	上海电力	109,667	631,681.92	0.12
187	000686	东北证券	31,299	629,109.90	0.11
188	000968	煤气化	24,623	623,700.59	0.11
189	000059	辽通化工	45,737	621,108.46	0.11

190	000959	首钢股份	137,475	607,639.50	0.11
191	000877	天山股份	16,903	600,732.62	0.11
192	000690	宝新能源	119,286	598,815.72	0.11
193	600600	青岛啤酒	17,502	597,518.28	0.11
194	000423	东阿阿胶	14,466	596,867.16	0.11
195	000768	西飞国际	53,292	586,744.92	0.11
196	600497	驰宏锌锗	26,598	586,485.90	0.11
197	600022	济南钢铁	122,506	584,353.62	0.11
198	600688	S 上石化	65,165	576,710.25	0.11
199	600655	豫园商城	52,927	575,845.76	0.11
200	600027	华电国际	172,297	572,026.04	0.10
201	600291	西水股份	45,572	567,827.12	0.10
202	000780	平庄能源	35,663	567,041.70	0.10
203	600859	王府井	14,163	566,095.11	0.10
204	000006	深振业 A	97,426	566,045.06	0.10
205	000540	中天城投	33,780	562,774.80	0.10
206	601106	中国一重	115,889	562,061.65	0.10
207	600569	安阳钢铁	151,172	559,336.40	0.10
208	601918	国投新集	45,934	558,557.44	0.10
209	000550	江铃汽车	21,202	556,976.54	0.10
210	000685	中山公用	33,311	554,295.04	0.10
211	600971	恒源煤电	13,672	551,801.92	0.10
212	600582	天地科技	24,922	551,773.08	0.10
213	600017	日照港	132,307	550,397.12	0.10
214	000659	珠海中富	51,986	548,972.16	0.10
215	600138	中青旅	41,054	541,912.80	0.10
216	600276	恒瑞医药	18,046	540,838.62	0.10
217	600782	新钢股份	76,613	537,057.13	0.10
218	600835	上海机电	44,708	528,895.64	0.10
219	600026	中海发展	61,954	522,891.76	0.10
220	600863	内蒙华电	58,888	521,747.68	0.10
221	600832	东方明珠	66,561	515,847.75	0.09
222	600550	天威保变	28,495	513,194.95	0.09
223	000939	凯迪电力	39,918	512,547.12	0.09
224	600380	健康元	54,905	505,675.05	0.09
225	000878	云南铜业	23,013	504,214.83	0.09
226	600231	凌钢股份	54,901	500,697.12	0.09
227	600963	岳阳林纸	58,378	499,715.68	0.09
228	600004	白云机场	62,888	496,186.32	0.09

229	600704	物产中大	28,048	495,888.64	0.09
230	002122	天马股份	38,712	495,513.60	0.09
231	600236	桂冠电力	89,538	495,145.14	0.09
232	600170	上海建工	31,427	489,946.93	0.09
233	600377	宁沪高速	90,204	488,003.64	0.09
234	000759	中百集团	39,214	483,116.48	0.09
235	601179	中国西电	79,053	482,223.30	0.09
236	600062	双鹤药业	19,424	481,520.96	0.09
237	600978	宜华木业	85,616	480,305.76	0.09
238	600221	海南航空	66,961	478,101.54	0.09
239	600085	同仁堂	13,396	477,701.36	0.09
240	600322	天房发展	88,928	472,207.68	0.09
241	600303	曙光股份	55,000	470,250.00	0.09
242	600522	中天科技	19,791	467,859.24	0.09
243	600307	酒钢宏兴	83,165	455,744.20	0.08
244	601872	招商轮船	117,545	450,197.35	0.08
245	600060	海信电器	33,443	448,805.06	0.08
246	000538	云南白药	7,837	447,335.96	0.08
247	000589	黔轮胎A	67,581	445,358.79	0.08
248	600125	铁龙物流	41,973	442,395.42	0.08
249	000089	深圳机场	79,087	437,351.11	0.08
250	600879	航天电子	35,714	434,282.24	0.08
251	600008	首创股份	75,636	428,099.76	0.08
252	600635	大众公用	71,334	420,870.60	0.08
253	000667	名流置业	139,202	416,213.98	0.08
254	600020	中原高速	124,053	411,855.96	0.08
255	000786	北新建材	25,676	408,505.16	0.07
256	600663	陆家嘴	29,019	405,685.62	0.07
257	002078	太阳纸业	38,110	404,347.10	0.07
258	000599	青岛双星	65,894	401,953.40	0.07
259	000088	盐田港	62,411	400,678.62	0.07
260	600611	大众交通	57,053	391,383.58	0.07
261	600827	友谊股份	23,109	391,235.37	0.07
262	000601	韶能股份	79,554	380,268.12	0.07
263	600598	北大荒	27,097	379,358.00	0.07
264	000407	胜利股份	69,798	379,003.14	0.07
265	000718	苏宁环球	47,339	378,712.00	0.07
266	600067	冠城大通	40,612	377,691.60	0.07
267	600096	云天化	18,920	376,318.80	0.07

268	600588	用友软件	18,188	375,764.08	0.07
269	002028	思源电气	27,425	375,448.25	0.07
270	600102	莱钢股份	39,066	370,345.68	0.07
271	002048	宁波华翔	30,927	370,196.19	0.07
272	600966	博汇纸业	49,472	370,050.56	0.07
273	600350	山东高速	87,563	362,510.82	0.07
274	600052	浙江广厦	80,674	357,385.82	0.07
275	000031	中粮地产	61,990	354,582.80	0.06
276	600469	风神股份	29,459	354,391.77	0.06
277	600601	方正科技	98,927	354,158.66	0.06
278	600595	中孚实业	34,793	349,321.72	0.06
279	600037	歌华有线	33,593	342,312.67	0.06
280	000999	华润三九	18,990	340,870.50	0.06
281	600622	嘉宝集团	40,988	340,610.28	0.06
282	601991	大唐发电	60,165	335,720.70	0.06
283	600183	生益科技	36,547	335,501.46	0.06
284	600657	信达地产	52,192	332,463.04	0.06
285	000066	长城电脑	46,823	332,443.30	0.06
286	600638	新黄浦	33,141	329,752.95	0.06
287	000875	吉电股份	71,980	324,629.80	0.06
288	600596	新安股份	30,734	323,321.68	0.06
289	600779	水井坊	14,147	317,175.74	0.06
290	000612	焦作万方	17,637	314,644.08	0.06
291	002007	华兰生物	9,183	311,671.02	0.06
292	000910	大亚科技	42,484	308,009.00	0.06
293	600006	东风汽车	69,471	304,282.98	0.06
294	600866	星湖科技	29,425	303,666.00	0.06
295	600529	山东药玻	19,822	258,677.10	0.05
296	000021	长城开发	30,658	253,848.24	0.05
297	601107	四川成渝	44,641	250,882.42	0.05
298	001696	宗申动力	31,585	227,096.15	0.04

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

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	002439	启明星辰	20,665	707,776.25	0.13
2	600718	东软集团	51,900	590,622.00	0.11

3	002422	科伦药业	5,400	318,600.00	0.06
4	600428	中远航运	35,400	255,588.00	0.05
5	002415	海康威视	5,600	220,024.00	0.04
6	601888	中国国旅	7,000	165,410.00	0.03
7	601268	二重重装	15,000	162,600.00	0.03
8	000927	一汽夏利	15,600	110,136.00	0.02
9	600239	云南城投	8,450	108,667.00	0.02
10	601288	农业银行	26,951	75,462.80	0.01
11	600331	宏达股份	3,800	50,578.00	0.01
12	002242	九阳股份	3,800	47,500.00	0.01
13	002405	四维图新	1,460	45,479.00	0.01
14	600703	三安光电	1,920	31,488.00	0.01

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 名的权益投资明细

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	601328	交通银行	13,740,427.00	2.22
2	600000	浦发银行	11,849,801.92	1.91
3	600050	中国联通	11,708,392.20	1.89
4	600016	民生银行	10,669,186.75	1.72
5	600036	招商银行	8,651,865.72	1.40
6	601166	兴业银行	7,614,832.23	1.23
7	600030	中信证券	6,539,414.68	1.06
8	000002	万科A	6,451,525.61	1.04
9	601088	中国神华	6,180,804.79	1.00
10	601318	中国平安	5,633,417.91	0.91
11	601398	工商银行	5,393,190.70	0.87
12	600519	贵州茅台	5,042,394.59	0.81
13	000858	五粮液	4,456,370.60	0.72
14	601668	中国建筑	4,160,909.45	0.67
15	600019	宝钢股份	4,108,929.00	0.66
16	600015	华夏银行	4,106,622.88	0.66
17	601006	大秦铁路	4,045,816.50	0.65
18	601299	中国北车	3,830,574.00	0.62

19	000651	格力电器	3,802,394.36	0.61
20	600585	海螺水泥	3,747,804.29	0.61

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	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	601328	交通银行	12,719,313.78	2.06
2	600050	中国联通	11,736,215.35	1.90
3	600000	浦发银行	9,058,212.72	1.46
4	600016	民生银行	8,656,462.91	1.40
5	600036	招商银行	8,379,863.38	1.35
6	601166	兴业银行	7,345,800.91	1.19
7	601088	中国神华	6,537,876.32	1.06
8	600030	中信证券	6,470,217.48	1.05
9	000002	万科A	6,377,251.46	1.03
10	601318	中国平安	5,499,295.38	0.89
11	601398	工商银行	5,289,499.17	0.85
12	600519	贵州茅台	4,641,605.49	0.75
13	000858	五粮液	4,536,522.49	0.73
14	600795	国电电力	4,514,151.92	0.73
15	600015	华夏银行	4,418,413.70	0.71
16	601668	中国建筑	4,109,673.77	0.66
17	600019	宝钢股份	4,020,138.86	0.65
18	601006	大秦铁路	3,913,726.56	0.63
19	000651	格力电器	3,784,292.00	0.61
20	000063	中兴通讯	3,774,788.96	0.61

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

7.4.3 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	382,959,983.72
卖出股票收入（成交）总额	447,204,366.58

注：表中“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	73,651.50	0.01
8	其他	-	-
9	合计	73,651.50	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110011	歌华转债	650	73,651.50	0.01

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.9.2 基金投资的前十名股票均未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	440,768.28
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	997,101.03
4	应收利息	7,721.19
5	应收申购款	102,786.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,548,376.99

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110011	歌华转债	73,651.50	0.01

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,453	81,992.56	403,303,018.84	76.22%	125,794,991.81	23.78%

8.2 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	598,106.43	0.1130%
----------------------	------------	---------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年4月23日）基金份额总额	1,165,158,636.81
本报告期期初基金份额总额	595,743,595.27
本报告期基金总申购份额	149,650,020.75
减：本报告期基金总赎回份额	216,295,605.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	529,098,010.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

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

- 1、本报告期本基金管理人没有重大人事变动。
- 2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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

本报告期基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有发生受到监管部门稽查或处罚的任何情况。

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	
中银国际	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	525,082,303.41	63.27%	446,326.94	64.09%	-
安信证券	1	133,469,455.78	16.08%	108,446.05	15.57%	-
国金证券	1	105,527,966.49	12.72%	85,742.99	12.31%	-
中信建投	1	65,782,779.60	7.93%	55,910.85	8.03%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）本报告期内本基金未新增、撤销席位；

（二）交易席位选择的标准和程序：

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，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- （1）经营规范，有较完备的内控制度；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- （3）能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

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

中银国际	-	-	-	-	-	-
申银万国	9,514.50	73.54%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	3,423.60	26.46%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

12.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 网址：<http://www.mfcteda.com>

泰达宏利基金管理有限公司
2011 年 8 月 25 日