

# 建信沪深 300 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：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

## §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 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

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.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
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.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40

10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件.....	43
§11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深300指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	建信沪深300指数 (LOF)
基金主代码	165309
交易代码	165309
基金运作方式	契约型、上市开放式
基金合同生效日	2009年11月5日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
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	4,307,188,156.89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	2009年11月30日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深300指数收益率 + $5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。
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风险、较高收益品种。

### 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		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	联系电话	010-66228888	010—66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010—66105798
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		江先周	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.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 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	-30,648,925.17
本期利润	-41,386,097.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0089
本期加权平均净值利润率	-1.00%
本期基金份额净值增长率	-2.26%
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	-578,732,250.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1344
期末基金资产净值	3,728,455,906.12
期末基金份额净值	0.866
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	-13.41%

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

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.88%	1.12%	1.35%	1.13%	0.53%	-0.01%
过去三个月	-4.73%	1.04%	-5.27%	1.04%	0.54%	0.00%
过去六个月	-2.26%	1.17%	-2.51%	1.17%	0.25%	0.00%
过去一年	17.66%	1.34%	17.91%	1.33%	-0.25%	0.01%

成立至今	-13.40%	1.39%	-11.09%	1.42%	-2.31%	-0.03%
------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

### 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

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2009 年 11 月 5 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：1、本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于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 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2011 年 2 月 9 日，中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率。作为本基金业绩比较基准的商业银行税后活期存款利率由 0.36% 上调至 0.40%。2011 年 4 月 6 日，该收益率上调至 0.50%。

3、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## §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

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股

份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的资产管理公司”。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金 15 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金 2 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 433.13 亿元。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀 先生	投资管理部 副总监，本 基金基金经 理	2009-11-05	-	8	注册金融分析师（CFA），2003 年 1 月获清华大学经济学博士学位，2003 年 1 月至 2005 年 8 月，就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 9 月加入本公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监，现任投资管理



					部副总监。2010 年 5 月 28 日起任上证社会责任 ETF 及其联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

## 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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

### 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

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金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

本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

## 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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内，本基金跟踪误差主要源自标的指数中工商银行和建设银行两只股票限于法律法规规定无法投资，必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人在

量化分析研究基础上,采取了相应的替代策略,并不断根据市场最新情况优化和调整替代方案,以达到尽可能降低跟踪误差及偏离度的目标。

在报告期内,个别时间段内遇到比较频繁的大额申购赎回、部分股票长期停牌等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响。本基金管理人已在日常管理中通过选择适当的策略尽力克服这些不利影响。

在报告期末,本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,为在 7 月 1 日进行的今年第 2 次沪深 300 指数成份股定期调整进行了准备,尽可能地降低了这一事件对基金跟踪误差及偏离度的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年本基金净值增长率-2.26%,波动率 1.17%,业绩比较基准收益率-2.51%,波动率 1.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为应对席卷全球的经济危机,政府在 2008 年末至 2009 年采取了超强的政策刺激手段,经济得以迅速复苏,但为此所支付的代价正逐渐显现。自 2010 年 4 季度开始,新一轮通胀来势汹汹,并于 2011 年 6 月创出 2 年多以来的新高。展望下半年,我们认为,通胀水平会继续在较高位置运行一段时间,随着基数的抬高以及货币政策的持续紧缩,通胀压力进一步增加的可能性有所降低,并有望在 4 季度暂时减轻,市场的悲观情绪可能会有所缓解。我们认为下半年沪深 300 指数可能依然呈现区间运行格局。

本基金管理人将根据基金合同,继续秉承被动复制策略,并以量化分析研究为基础,克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌等各种因素造成的不利影响,不断优化和改进量化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[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》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方

法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本报告期内,公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末本基金可供分配利润为-578,732,250.77 元,根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定,未达到进行利润分配的条件,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,本基金托管人在对建信沪深 300 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,建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信沪深 300 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,建信沪深 300 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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信沪深 300 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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2011 年 8 月 19 日

## §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:建信沪深 300 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
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	97,830,473.95	148,878,218.14
结算备付金		260,670.51	2,771,079.64
存出保证金		1,138,404.46	779,415.77
交易性金融资产	6.4.7.2	3,637,058,215.83	4,473,933,602.69
其中:股票投资		3,537,808,215.83	4,373,573,602.69
基金投资		-	-
债券投资		99,250,000.00	100,360,000.00
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		14,682,983.17	17,491,000.96

应收利息	6.4.7.5	628,458.24	3,257,245.83
应收股利		2,396,297.39	-
应收申购款		96,487.61	1,493,600.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,754,091,991.16	4,648,604,163.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,499,239.67	19,569,330.10
应付赎回款		1,745,008.18	944,323.54
应付管理人报酬		2,227,997.10	2,983,144.57
应付托管费		445,599.43	596,628.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,428,421.56	5,305,338.14
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	289,819.10	175,620.55
负债合计		25,636,085.04	29,574,385.82
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,307,188,156.89	5,213,405,911.30
未分配利润	6.4.7.10	-578,732,250.77	-594,376,133.72
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,728,455,906.12</b>	<b>4,619,029,777.58</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,754,091,991.16</b>	<b>4,648,604,163.40</b>

注: 报告截止日 2011 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.866 元, 基金份额总额 4,307,188,156.89

份。

## 6.2 利润表

会计主体: 建信沪深 300 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1月1日至 2010年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-19,094,716.32</b>	<b>-1,247,868,031.50</b>
1.利息收入		2,404,743.35	1,451,577.47
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	498,177.64	597,868.31
债券利息收入		1,906,565.71	853,709.16
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)		-12,330,368.02	-55,264,828.34
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-41,842,827.58	-79,631,115.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,876,510.76	-6,600.00
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	31,388,970.32	24,372,887.55
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-10,737,172.75	-1,194,708,392.21
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	1,568,081.10	653,611.58
<b>减: 二、费用</b>		<b>22,291,381.60</b>	<b>21,019,040.97</b>
1.管理人报酬		15,426,686.66	15,559,837.45
2.托管费		3,085,337.33	3,111,967.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	3,524,296.05	2,086,747.15
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	255,061.56	260,488.87
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-41,386,097.92</b>	<b>-1,268,887,072.47</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-41,386,097.92</b>	<b>-1,268,887,072.47</b>

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 建信沪深 300 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)	5,213,405,911.30	-594,376,133.72	4,619,029,777.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-41,386,097.92	-41,386,097.92
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)	-906,217,754.41	57,029,980.87	-849,187,773.54
其中: 1.基金申购款	631,834,423.60	-76,412,331.35	555,422,092.25
2.基金赎回款	-1,538,052,178.01	133,442,312.22	-1,404,609,865.79
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)	4,307,188,156.89	-578,732,250.77	3,728,455,906.12

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 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)	4,610,567,360.02	45,649,643.62	4,656,217,003.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-1,268,887,072.47	-1,268,887,072.47
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)	661,716,654.32	-170,711,488.42	491,005,165.90
其中: 1.基金申购款	1,235,287,360.67	-221,405,718.14	1,013,881,642.53
2.基金赎回款	-573,570,706.35	50,694,229.72	-522,876,476.63
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)	5,272,284,014.34	-1,393,948,917.27	3,878,335,097.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 孙志晨, 主管会计工作负责人: 何斌, 会计机构负责人: 秦绪华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(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[2009]第 882 号《关于核准建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准, 由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2009 年 9 月 21 日至 2009 年 10 月 30 日止。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 5,324,471,976.73 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(2009)第 233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 11 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 5,326,413,369.61 份基金份额, 其中认购资金利息折合 1,941,392.88 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司, 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”)深证上字[2009]第 157 号文审核同意, 本基金 59,552,590.00 份基金份额于 2009 年 11 月 30 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《建信沪深 300 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, 包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%, 投资于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 5%。本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。

#### 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》、《建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列表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 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间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

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### 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》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关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	97,830,473.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	97,830,473.95

##### 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	3,733,529,534.66	3,537,808,215.83	-195,721,318.83	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	99,281,300.00	99,250,000.00	-31,300.00
	合计	99,281,300.00	99,250,000.00	-31,300.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,832,810,834.66	3,637,058,215.83	-195,752,618.83	

注:债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为 1,604,500.00 元。

##### 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或负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售基金资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 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	19,110.17
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	117.30
应收债券利息	609,230.77
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	628,458.24

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	4,428,021.56
银行间市场应付交易费用	400.00
合计	4,428,421.56

#### 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	3,745.98
预提费用	286,073.12
合计	289,819.10

#### 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	5,213,405,911.30	5,213,405,911.30
本期申购	631,834,423.60	631,834,423.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,538,052,178.01	-1,538,052,178.01
本期末	4,307,188,156.89	4,307,188,156.89

注：截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 21,854,049.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 4,285,334,107.89 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 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	-166,975,958.76	-427,400,174.96	-594,376,133.72
本期利润	-30,648,925.17	-10,737,172.75	-41,386,097.92
本期基金份额交易产生的变动数	32,025,134.48	25,004,846.39	57,029,980.87
其中：基金申购款	-21,607,594.07	-54,804,737.28	-76,412,331.35
基金赎回款	53,632,728.55	79,809,583.67	133,442,312.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-165,599,749.45	-413,132,501.32	-578,732,250.77

#### 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	476,703.43
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	7,054.24
其他	14,419.97
合计	498,177.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,437,552,112.95
减：卖出股票成本总额	1,479,394,940.53
买卖股票差价收入	-41,842,827.58

#### 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	105,295,417.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	102,611,800.00
减：应收利息总额	4,560,128.26
债券投资收益	-1,876,510.76

#### 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

本基金本报告期间无衍生工具收益。

#### 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	31,388,970.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,388,970.32

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-10,737,172.75
——股票投资	-12,341,672.75
——债券投资	1,604,500.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-10,737,172.75

#### 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	1,568,081.10
合计	1,568,081.10

注：本基金的场内份额赎回费率为赎回金额 0.5%，场外份额赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 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	3,523,896.05
银行间市场交易费用	400.00
合计	3,524,296.05

#### 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	57,027.67
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行间划款手续费	10,515.40
银行间账户维护费	9,000.00
合计	255,061.56

#### 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

截至资产负债表日，本基金至本报告期末未存在或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、基金转型等非调整事项。

#### 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

经建信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")2010年度第二次临时股东会审议通过，并于2011年5月4日中国证监会证监许可[2011]648号文批准，本公司原股东中国华电集团公司将所持有的建信基金管理有限责任公司10%的股权转让给中国华电集团资本控股有限公司。该事项已于2011年6月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报及我公司网站公开披露。

##### 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
建信基金管理有限责任公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交

易。

#### 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1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,426,686.66	15,559,837.45
其中：支付销售机构的客户维护费	4,062,104.61	4,673,875.52

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.75% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 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1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,085,337.33	3,111,967.50

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未存在与关联方进行的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期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末均未持有本基金。

#### 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1月1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	97,830,473.95	476,703.43	168,795,486.93	558,357.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
600170	上海建工	2011-06-29	筹划重大资产重组事项	15.59	2011-07-04	16.25	272,793	3,967,313.89	4,252,842.87	-
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票融资事宜	31.39	2011-07-04	32.60	176,727	5,917,629.29	5,547,460.53	-
600369	西南证券	2011-03-01	筹划重大资产重组事项	11.87	-	-	351,833	5,714,453.83	4,176,257.71	-
601998	中信银行	2011-06-29	筹划配股事项停牌	4.75	2011-07-07	4.59	1,959,517	11,951,186.87	9,307,705.75	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大事项停牌	7.78	2011-07-08	7.68	907,878	7,785,133.49	7,063,290.84	-
000876	新希望	2011-06-29	筹划重大资产重组事项	19.95	2011-07-05	21.95	272,475	3,611,117.47	5,435,876.25	-
000959	首钢股份	2010-	筹划重大	4.42	-	-	1,070,227	5,781,324.91	4,730,403.34	-

		10-29	资产重组 事项						
--	--	-------	------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

本基金本报告期末无银行间正回购余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购品种。

### 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风险、较高收益品种。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金对标的指数的跟踪目标：力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计与风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营中的风险控制政策，组织制定公司经营中的内部风险控制制度；对公司管理层在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督，管理层应如实向风险管理委员会汇报有关风险控制情况；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，风险管理



部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制；监察稽核部承担合规风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、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人中信银行，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股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

#### 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。因此除报告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,其余均能及时变现。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 利率风险的敏感性分析**

于 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 2.66%(2010 年 12 月 31 日: 2.17%), 因此市场利率的变动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 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。

本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数, 并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%, 投资于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 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。

**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	3,537,808,215.83	94.89	4,373,573,602.69	94.69
衍生金融资产-权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,537,808,215.83	94.89	4,373,573,602.69	94.69

**6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升5%		增加约186,049,949.72	增加约228,816,385.40
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降5%		减少约186,049,949.72	减少约228,816,385.40

#### 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中属于第一层级的余额为 3,497,294,378.54 元,属于第二层级的余额为 139,763,837.29 元,无属于第三层级的余额(2010 年 6 月 30 日: 第一层级 3,409,851,836.49 元,第二层级 285,281,537.63 元,无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(上年度可比期间: 同)。

对于持有的认购新发和增发证券,本基金将相关股票公允价值所属层级于流通受限期间列入第二层级,待其可流通后从第二层级转入第一层级(上年度可比期间: 同)。

于本会计期间内,本基金持有的河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票(“双汇发展”)因重大事项停牌。由于该重大事项对于双汇发展估值的影响程度更多取决于不可观察的输入值,本基金于停牌期间将双汇发展从第一层级转入第

三层级，并于复牌后打开跌停之日起将其从第三层级转回第一层级。在上述层级转换中，从第一层级转入第三层级时涉及的公允价值为 15,902,373.65 元，从第三层级转回第一层时涉及的公允价值为 12,256,945.60 元（在从第三层级转回第一层级前卖出股票实现收益 262,420.91 元），在估值属于第三层级期间计入损益的公允价值变动损失为 1,412,764.00 元。

(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	3,537,808,215.83	94.24
	其中：股票	3,537,808,215.83	94.24
2	固定收益投资	99,250,000.00	2.64
	其中：债券	99,250,000.00	2.64
	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	98,091,144.46	2.61
6	其他各项资产	18,942,630.87	0.50
7	合计	3,754,091,991.16	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末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	19,326,362.37	0.52
B	采掘业	416,414,187.49	11.17
C	制造业	1,300,968,895.97	34.89
C0	食品、饮料	214,962,920.20	5.77
C1	纺织、服装、皮毛	12,250,541.73	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	87,262,481.25	2.34
C5	电子	37,913,688.30	1.02
C6	金属、非金属	327,870,616.64	8.79
C7	机械、设备、仪表	469,498,544.01	12.59
C8	医药、生物制品	144,142,664.24	3.87
C99	其他制造业	7,067,439.60	0.19

D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,357,370.02	2.10
E	建筑业	113,018,036.88	3.03
F	交通运输、仓储业	134,056,100.11	3.60
G	信息技术业	113,857,941.04	3.05
H	批发和零售贸易	106,508,338.14	2.86
I	金融、保险业	968,757,458.80	25.98
J	房地产业	172,018,313.52	4.61
K	社会服务业	30,458,787.91	0.82
L	传播与文化产业	6,757,384.88	0.18
M	综合类	77,309,038.70	2.07
	合计	3,537,808,215.83	94.89

注：以上行业分类以 2011 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

## 7.2.2 积极投资期末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	600036	招商银行	8,544,190	111,245,353.80	2.98
2	601318	中国平安	2,107,304	101,719,564.08	2.73
3	600016	民生银行	14,206,574	81,403,669.02	2.18
4	601328	交通银行	13,584,679	75,259,121.66	2.02
5	600000	浦发银行	7,039,311	69,266,820.24	1.86
6	601288	农业银行	24,238,208	67,866,982.40	1.82
7	601166	兴业银行	4,748,914	64,015,360.72	1.72
8	601088	中国神华	2,074,423	62,523,109.22	1.68
9	600030	中信证券	4,378,776	57,274,390.08	1.54
10	000002	万科A	6,088,440	51,447,318.00	1.38
11	600519	贵州茅台	237,443	50,487,505.09	1.35
12	601601	中国太保	1,977,025	44,265,589.75	1.19
13	600837	海通证券	4,822,940	43,502,918.80	1.17
14	000858	五粮液	1,193,746	42,640,607.12	1.14
15	601668	中国建筑	9,113,452	36,727,211.56	0.99
16	600585	海螺水泥	1,257,816	34,916,972.16	0.94
17	600031	三一重工	1,910,439	34,464,319.56	0.92
18	002024	苏宁电器	2,640,180	33,820,705.80	0.91
19	600111	包钢稀土	457,007	32,644,010.01	0.88
20	601006	大秦铁路	3,740,215	30,632,360.85	0.82
21	000001	深发展A	1,753,533	29,932,808.31	0.80
22	000651	格力电器	1,240,627	29,154,734.50	0.78
23	600050	中国联通	5,332,678	27,996,559.50	0.75
24	601169	北京银行	2,741,798	27,335,726.06	0.73
25	000157	中联重科	1,770,134	27,224,660.92	0.73

26	601857	中国石油	2,363,235	25,735,629.15	0.69
27	000063	中兴通讯	883,836	24,994,882.08	0.67
28	600048	保利地产	2,244,737	24,669,659.63	0.66
29	601988	中国银行	7,828,166	24,580,441.24	0.66
30	601899	紫金矿业	3,313,292	23,988,234.08	0.64
31	000983	西山煤电	990,981	23,981,740.20	0.64
32	601989	中国重工	1,729,748	23,853,224.92	0.64
33	000527	美的电器	1,277,161	23,486,990.79	0.63
34	000792	盐湖股份	383,075	22,601,425.00	0.61
35	600900	长江电力	3,113,325	22,447,073.25	0.60
36	600104	上海汽车	1,162,613	21,787,367.62	0.58
37	600028	中国石化	2,618,965	21,554,081.95	0.58
38	600089	特变电工	1,657,648	21,449,965.12	0.58
39	000338	潍柴动力	462,429	21,008,149.47	0.56
40	000776	广发证券	533,260	20,930,455.00	0.56
41	600547	山东黄金	454,598	20,384,174.32	0.55
42	600019	宝钢股份	3,304,285	19,924,838.55	0.53
43	000568	泸州老窖	438,457	19,783,179.84	0.53
44	601699	潞安环能	578,911	18,994,069.91	0.51
45	002304	洋河股份	150,543	18,992,504.88	0.51
46	601600	中国铝业	1,705,216	18,774,428.16	0.50
47	600015	华夏银行	1,723,267	18,731,912.29	0.50
48	600362	江西铜业	522,095	18,503,046.80	0.50
49	600348	国阳新能	756,318	18,257,516.52	0.49
50	600383	金地集团	2,812,376	18,027,330.16	0.48
51	601628	中国人寿	943,434	17,689,387.50	0.47
52	601766	中国南车	2,469,527	17,583,032.24	0.47
53	600256	广汇股份	734,695	17,471,047.10	0.47
54	601168	西部矿业	1,173,496	17,391,210.72	0.47
55	600887	伊利股份	1,005,476	16,741,175.40	0.45
56	600739	辽宁成大	572,001	15,901,627.80	0.43
57	600489	中金黄金	581,789	15,877,021.81	0.43
58	600068	葛洲坝	1,316,072	15,779,703.28	0.42
59	600795	国电电力	5,005,845	14,817,301.20	0.40
60	600999	招商证券	801,621	14,733,793.98	0.40
61	600406	国电南瑞	396,377	14,388,485.10	0.39
62	600690	青岛海尔	505,665	14,133,336.75	0.38
63	601299	中国北车	2,088,129	13,990,464.30	0.38
64	000069	华侨城 A	1,759,017	13,913,824.47	0.37
65	000423	东阿阿胶	329,080	13,577,840.80	0.36
66	600010	包钢股份	1,616,072	13,494,201.20	0.36
67	600188	兖州煤业	372,342	13,143,672.60	0.35
68	601390	中国中铁	3,225,124	12,868,244.76	0.35
69	000425	徐工机械	518,953	12,864,844.87	0.35
70	600518	康美药业	968,024	12,739,195.84	0.34
71	600309	烟台万华	680,006	12,722,912.26	0.34
72	000012	南玻 A	769,899	12,703,333.50	0.34
73	000895	双汇发展	190,572	12,591,092.04	0.34
74	002202	金风科技	828,160	12,364,428.80	0.33

75	601688	华泰证券	996,745	12,309,800.75	0.33
76	000060	中金岭南	908,248	12,079,698.40	0.32
77	601618	中国中冶	3,064,078	12,072,467.32	0.32
78	601919	中国远洋	1,440,748	11,943,800.92	0.32
79	000039	中集集团	542,374	11,867,143.12	0.32
80	601788	光大证券	859,907	11,823,721.25	0.32
81	000009	中国宝安	686,033	11,813,488.26	0.32
82	600150	中国船舶	159,584	11,807,620.16	0.32
83	000709	河北钢铁	2,595,110	11,729,897.20	0.31
84	601009	南京银行	1,307,127	11,724,929.19	0.31
85	601958	金铂股份	608,817	11,719,727.25	0.31
86	601186	中国铁建	1,936,157	11,713,749.85	0.31
87	601898	中煤能源	1,151,239	11,512,390.00	0.31
88	000402	金融街	1,523,117	11,377,683.99	0.31
89	000937	冀中能源	436,410	11,062,993.50	0.30
90	000630	铜陵有色	447,063	10,774,218.30	0.29
91	600875	东方电气	418,597	10,674,223.50	0.29
92	000623	吉林敖东	346,192	10,666,175.52	0.29
93	600276	恒瑞医药	353,520	10,594,994.40	0.28
94	600005	武钢股份	2,539,412	10,538,559.80	0.28
95	600415	小商品城	855,884	10,518,814.36	0.28
96	600132	重庆啤酒	182,638	10,483,421.20	0.28
97	601666	平煤股份	742,533	10,402,887.33	0.28
98	600029	南方航空	1,325,079	10,388,619.36	0.28
99	601607	上海医药	614,304	10,320,307.20	0.28
100	000725	京东方 A	3,700,956	10,103,609.88	0.27
101	601111	中国国航	1,047,747	10,047,893.73	0.27
102	000538	云南白药	174,665	9,969,878.20	0.27
103	600881	亚泰集团	1,191,701	9,926,869.33	0.27
104	000933	神火股份	633,987	9,642,942.27	0.26
105	000783	长江证券	894,839	9,637,416.03	0.26
106	000528	柳工	424,636	9,609,512.68	0.26
107	000100	TCL 集团	3,198,694	9,564,095.06	0.26
108	000401	冀东水泥	381,389	9,530,911.11	0.26
109	601998	中信银行	1,959,517	9,307,705.75	0.25
110	600058	五矿发展	269,674	9,244,424.72	0.25
111	000825	太钢不锈	1,791,341	9,225,406.15	0.25
112	600100	同方股份	875,122	9,153,776.12	0.25
113	600660	福耀玻璃	881,852	9,135,986.72	0.25
114	600497	驰宏锌锗	411,996	9,084,511.80	0.24
115	600642	申能股份	1,784,511	9,047,470.77	0.24
116	600123	兰花科创	215,556	9,005,929.68	0.24
117	600271	航天信息	338,562	8,748,442.08	0.23
118	600143	金发科技	527,001	8,674,436.46	0.23
119	000878	云南铜业	395,201	8,658,853.91	0.23
120	000768	西飞国际	779,155	8,578,496.55	0.23
121	601727	上海电气	1,239,131	8,574,786.52	0.23
122	000758	中色股份	241,096	8,522,743.60	0.23
123	000960	锡业股份	285,081	8,295,857.10	0.22



124	600177	雅戈尔	840,263	8,293,395.81	0.22
125	601117	中国化学	930,790	8,246,799.40	0.22
126	002073	软控股份	387,441	7,981,284.60	0.21
127	601106	中国一重	1,644,842	7,977,483.70	0.21
128	000024	招商地产	433,337	7,930,067.10	0.21
129	002142	宁波银行	725,517	7,893,624.96	0.21
130	000898	鞍钢股份	1,160,234	7,889,591.20	0.21
131	600009	上海机场	615,564	7,879,219.20	0.21
132	601818	光大银行	2,350,003	7,872,510.05	0.21
133	600655	豫园商城	723,209	7,868,513.92	0.21
134	600583	海油工程	1,223,141	7,852,565.22	0.21
135	600550	天威保变	431,775	7,776,267.75	0.21
136	600832	东方明珠	1,002,030	7,765,732.50	0.21
137	600115	东方航空	1,468,398	7,635,669.60	0.20
138	000778	新兴铸管	723,375	7,631,606.25	0.20
139	600153	建发股份	844,467	7,515,756.30	0.20
140	600600	青岛啤酒	218,849	7,471,504.86	0.20
141	600320	振华重工	1,110,827	7,386,999.55	0.20
142	600664	哈药股份	468,699	7,358,574.30	0.20
143	601333	广深铁路	1,777,500	7,305,525.00	0.20
144	000800	一汽轿车	511,812	7,247,257.92	0.19
145	600741	华域汽车	649,887	7,233,242.31	0.19
146	601001	大同煤业	421,073	7,158,241.00	0.19
147	000422	湖北宣化	341,132	7,139,892.76	0.19
148	600549	厦门钨业	171,574	7,108,310.82	0.19
149	000652	泰达股份	907,878	7,063,290.84	0.19
150	600694	大商股份	184,736	7,062,457.28	0.19
151	600166	福田汽车	796,133	6,910,434.44	0.19
152	600395	盘江股份	208,191	6,909,859.29	0.19
153	601101	昊华能源	109,337	6,900,258.07	0.19
154	002155	辰州矿业	206,574	6,752,904.06	0.18
155	000680	山推股份	381,984	6,719,098.56	0.18
156	600535	天士力	162,403	6,679,635.39	0.18
157	600219	南山铝业	709,208	6,673,647.28	0.18
158	601808	中海油服	372,400	6,651,064.00	0.18
159	600196	复星医药	598,889	6,515,912.32	0.17
160	002001	新 和 成	220,411	6,491,103.95	0.17
161	000729	燕京啤酒	380,602	6,458,815.94	0.17
162	601179	中国西电	1,049,538	6,402,181.80	0.17
163	000969	安泰科技	324,120	6,330,063.60	0.17
164	600970	中材国际	229,212	6,264,363.96	0.17
165	600598	北大荒	447,232	6,261,248.00	0.17
166	600376	首开股份	470,042	6,209,254.82	0.17
167	600997	开滦股份	388,267	6,196,741.32	0.17
168	600352	浙江龙盛	646,497	6,193,441.26	0.17
169	600804	鹏博士	784,598	6,190,478.22	0.17
170	600169	太原重工	609,823	6,189,703.45	0.17
171	600631	百联股份	415,498	6,182,610.24	0.17
172	000839	中信国安	591,695	6,159,544.95	0.17

173	002007	华兰生物	181,204	6,150,063.76	0.16
174	600418	江淮汽车	553,552	6,149,962.72	0.16
175	000562	宏源证券	367,613	6,142,813.23	0.16
176	600125	铁龙物流	574,780	6,058,181.20	0.16
177	600208	新湖中宝	968,619	6,034,496.37	0.16
178	000625	长安汽车	657,066	6,012,153.90	0.16
179	600812	华北制药	517,543	5,962,095.36	0.16
180	600703	三安光电	363,288	5,957,923.20	0.16
181	600331	宏达股份	443,239	5,899,511.09	0.16
182	600649	城投控股	722,699	5,868,315.88	0.16
183	600811	东方集团	851,933	5,861,299.04	0.16
184	600085	同仁堂	163,789	5,840,715.74	0.16
185	600316	洪都航空	180,413	5,814,710.99	0.16
186	600809	山西汾酒	81,687	5,722,174.35	0.15
187	002106	莱宝高科	187,888	5,683,612.00	0.15
188	600582	天地科技	254,501	5,634,652.14	0.15
189	000728	国元证券	494,132	5,583,691.60	0.15
190	600216	浙江医药	176,727	5,547,460.53	0.15
191	600893	航空动力	319,323	5,521,094.67	0.15
192	601866	中海集运	1,496,684	5,447,929.76	0.15
193	002128	露天煤业	250,328	5,444,634.00	0.15
194	000876	新希望	272,475	5,435,876.25	0.15
195	000061	农产品	338,350	5,400,066.00	0.14
196	000869	张裕A	54,595	5,393,986.00	0.14
197	600062	双鹤药业	215,743	5,348,268.97	0.14
198	002422	科伦药业	90,570	5,343,630.00	0.14
199	600221	海南航空	743,570	5,309,089.80	0.14
200	600108	亚盛集团	873,991	5,305,125.37	0.14
201	600588	用友软件	256,624	5,301,851.84	0.14
202	600066	宇通客车	228,892	5,296,560.88	0.14
203	600516	方大炭素	402,241	5,281,424.33	0.14
204	600839	四川长虹	1,566,979	5,233,709.86	0.14
205	600859	王府井	130,800	5,228,076.00	0.14
206	600808	马钢股份	1,501,378	5,224,795.44	0.14
207	600018	上港集团	1,338,060	5,218,434.00	0.14
208	000059	辽通化工	377,532	5,126,884.56	0.14
209	600267	海正药业	136,813	5,108,597.42	0.14
210	601118	海南橡胶	410,400	5,056,128.00	0.14
211	601158	重庆水务	603,797	4,987,363.22	0.13
212	600118	中国卫星	221,731	4,968,991.71	0.13
213	600879	航天电子	408,087	4,962,337.92	0.13
214	600635	大众公用	827,639	4,883,070.10	0.13
215	600718	东软集团	423,822	4,823,094.36	0.13
216	600779	水井坊	215,092	4,822,362.64	0.13
217	000807	云铝股份	446,802	4,807,589.52	0.13
218	600595	中孚实业	476,394	4,782,995.76	0.13
219	002092	中泰化学	363,014	4,762,743.68	0.13
220	000959	首钢股份	1,070,227	4,730,403.34	0.13
221	600895	张江高科	494,726	4,670,213.44	0.13

222	600239	云南城投	362,530	4,662,135.80	0.13
223	002122	天马股份	360,797	4,618,201.60	0.12
224	600432	吉恩镍业	204,064	4,546,545.92	0.12
225	600500	中化国际	452,090	4,516,379.10	0.12
226	600508	上海能源	181,823	4,431,026.51	0.12
227	000999	华润三九	246,274	4,420,618.30	0.12
228	600546	山煤国际	141,515	4,413,852.85	0.12
229	600717	天津港	526,677	4,308,217.86	0.12
230	601018	宁波港	1,336,400	4,276,480.00	0.11
231	600170	上海建工	272,793	4,252,842.87	0.11
232	601918	国投新集	349,143	4,245,578.88	0.11
233	600675	中华企业	622,733	4,234,584.40	0.11
234	600266	北京城建	279,634	4,208,491.70	0.11
235	600312	平高电气	412,074	4,182,551.10	0.11
236	600369	西南证券	351,833	4,176,257.71	0.11
237	000968	煤气化	161,562	4,092,365.46	0.11
238	600037	歌华有线	400,152	4,077,548.88	0.11
239	000780	平庄能源	255,182	4,057,393.80	0.11
240	600528	中铁二局	458,886	3,987,719.34	0.11
241	600220	江苏阳光	785,148	3,957,145.92	0.11
242	601377	兴业证券	229,648	3,956,835.04	0.11
243	601888	中国国旅	166,044	3,923,619.72	0.11
244	600008	首创股份	691,850	3,915,871.00	0.11
245	600456	宝钛股份	135,309	3,905,017.74	0.10
246	002399	海普瑞	100,658	3,896,471.18	0.10
247	600428	中远航运	531,607	3,838,202.54	0.10
248	000690	宝新能源	760,173	3,816,068.46	0.10
249	000612	焦作万方	211,407	3,771,500.88	0.10
250	000027	深圳能源	498,697	3,760,175.38	0.10
251	600481	双良节能	254,755	3,683,757.30	0.10
252	002146	荣盛发展	371,578	3,641,464.40	0.10
253	002493	荣盛石化	116,090	3,586,020.10	0.10
254	600096	云天化	174,506	3,470,924.34	0.09
255	600269	赣粤高速	734,433	3,459,179.43	0.09
256	000021	长城开发	414,883	3,435,231.24	0.09
257	000718	苏宁环球	428,359	3,426,872.00	0.09
258	000951	中国重汽	184,660	3,412,516.80	0.09
259	600674	川投能源	234,707	3,365,698.38	0.09
260	600026	中海发展	397,856	3,357,904.64	0.09
261	600151	航天机电	290,850	3,353,500.50	0.09
262	000559	万向钱潮	415,800	3,343,032.00	0.09
263	600863	内蒙华电	373,830	3,312,133.80	0.09
264	000031	中粮地产	570,378	3,262,562.16	0.09
265	600737	中粮屯河	316,240	3,241,460.00	0.09
266	000686	东北证券	160,840	3,232,884.00	0.09
267	600823	世茂股份	220,876	3,231,415.88	0.09
268	600183	生益科技	344,237	3,160,095.66	0.08
269	002244	滨江集团	255,104	3,137,779.20	0.08
270	600380	健康元	331,447	3,052,626.87	0.08

271	002310	东方园林	31,341	2,820,690.00	0.08
272	600307	酒钢宏兴	514,656	2,820,314.88	0.08
273	600517	置信电气	233,483	2,818,139.81	0.08
274	601718	际华集团	604,000	2,778,400.00	0.07
275	600971	恒源煤电	68,600	2,768,696.00	0.07
276	600161	天坛生物	162,103	2,747,645.85	0.07
277	600109	国金证券	188,733	2,746,065.15	0.07
278	600300	维维股份	525,806	2,707,900.90	0.07
279	002069	獐子岛	111,270	2,703,861.00	0.07
280	601098	中南传媒	281,200	2,679,836.00	0.07
281	601717	郑煤机	73,000	2,661,580.00	0.07
282	601558	华锐风电	87,740	2,564,640.20	0.07
283	002415	海康威视	62,896	2,471,183.84	0.07
284	000961	中南建设	220,356	2,322,552.24	0.06
285	601268	二重重装	212,587	2,304,443.08	0.06
286	002294	信立泰	68,531	2,301,956.29	0.06
287	601107	四川成渝	408,080	2,293,409.60	0.06
288	002500	山西证券	250,500	2,292,075.00	0.06
289	600004	白云机场	289,320	2,282,734.80	0.06
290	002028	思源电气	165,924	2,271,499.56	0.06
291	601369	陕鼓动力	206,143	2,261,388.71	0.06
292	000927	一汽夏利	300,988	2,124,975.28	0.06
293	601933	永辉超市	80,042	1,936,215.98	0.05
294	002405	四维图新	60,415	1,881,927.25	0.05
295	000685	中山公用	113,021	1,880,669.44	0.05
296	600998	九州通	148,300	1,831,505.00	0.05
297	000536	华映科技	73,100	1,697,382.00	0.05
298	002385	大北农	50,417	1,633,510.80	0.04
299	002498	汉缆股份	73,600	1,422,688.00	0.04
300	601519	大智慧	72,510	1,134,056.40	0.03
301	600601	方正科技	234,683	840,165.14	0.02
302	600325	华发股份	69,889	784,154.58	0.02
303	600210	紫江企业	122,896	737,376.00	0.02
304	000046	泛海建设	73,092	641,747.76	0.02
305	600663	陆家嘴	43,563	609,010.74	0.02
306	600017	日照港	140,637	585,049.92	0.02
307	000667	名流置业	191,575	572,809.25	0.02
308	600596	新安股份	50,834	534,773.68	0.01
309	600087	长航油运	181,458	528,042.78	0.01
310	000900	现代投资	29,876	486,978.80	0.01
311	600033	福建高速	146,719	475,369.56	0.01
312	600611	大众交通	66,862	458,673.32	0.01
313	600006	东风汽车	85,538	374,656.44	0.01
314	601877	正泰电器	21,492	372,456.36	0.01
315	600597	光明乳业	44,873	355,842.89	0.01
316	600748	上实发展	46,335	335,465.40	0.01
317	600657	信达地产	48,894	311,454.78	0.01
318	002242	九阳股份	24,409	305,112.50	0.01
319	601099	太平洋	32,148	302,834.16	0.01

320	600350	山东高速	71,934	297,806.76	0.01
321	601139	深圳燃气	26,303	275,655.44	0.01

### 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	601288	农业银行	37,906,320.64	0.82
2	000776	广发证券	18,875,508.16	0.41
3	601988	中国银行	18,640,346.80	0.40
4	600036	招商银行	18,405,058.55	0.40
5	600837	海通证券	16,862,934.92	0.37
6	002304	洋河股份	12,124,202.86	0.26
7	601318	中国平安	9,919,619.99	0.21
8	601989	中国重工	9,553,386.33	0.21
9	600000	浦发银行	9,397,811.34	0.20
10	600582	天地科技	8,907,244.10	0.19
11	601328	交通银行	8,653,682.02	0.19
12	002073	软控股份	7,930,867.22	0.17
13	600016	民生银行	7,890,627.60	0.17
14	601668	中国建筑	7,722,101.90	0.17
15	601166	兴业银行	7,519,309.53	0.16
16	600999	招商证券	6,927,930.21	0.15
17	601088	中国神华	6,774,973.00	0.15
18	601600	中国铝业	6,248,456.86	0.14
19	002106	莱宝高科	5,680,598.42	0.12
20	000157	中联重科	5,636,869.57	0.12

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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	600036	招商银行	43,360,160.67	0.94
2	601988	中国银行	41,360,532.39	0.90
3	601328	交通银行	40,640,341.57	0.88
4	601318	中国平安	38,153,179.60	0.83
5	600000	浦发银行	28,740,419.53	0.62
6	600016	民生银行	28,365,466.61	0.61
7	601166	兴业银行	27,108,987.97	0.59
8	601088	中国神华	22,114,418.15	0.48
9	600030	中信证券	21,895,916.91	0.47
10	000002	万科 A	18,932,922.42	0.41

11	601601	中国太保	16,246,604.86	0.35
12	600519	贵州茅台	15,556,759.09	0.34
13	000858	五粮液	14,627,531.69	0.32
14	002024	苏宁电器	12,475,480.51	0.27
15	600031	三一重工	12,242,444.80	0.27
16	601288	农业银行	12,208,573.59	0.26
17	000001	深发展A	11,659,247.96	0.25
18	601169	北京银行	11,495,235.39	0.25
19	601006	大秦铁路	11,453,308.73	0.25
20	600585	海螺水泥	11,344,878.49	0.25

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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	655,971,226.42
卖出股票收入（成交）总额	1,437,552,112.95

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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	99,250,000.00	2.66
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	99,250,000.00	2.66

### 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	1101023	11 央行票据 23	1,000,000	99,250,000.00	2.66

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.9.2** 本基金投资的前十名股票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	1,138,404.46
2	应收证券清算款	14,682,983.17
3	应收股利	2,396,297.39
4	应收利息	628,458.24
5	应收申购款	96,487.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,942,630.87

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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股票。

## §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
76,539	56,274.42	1,053,758,442.20	24.47%	3,253,429,714.69	75.53%

### 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	庄秋玉	1,484,192.00	6.79%
2	蒋云鹏	1,004,480.00	4.60%
3	张小玲	994,500.00	4.55%

4	罗霖	614,620.00	2.81%
5	许新梅	505,218.00	2.31%
6	于晓东	500,035.00	2.29%
7	青海旭阳机电有限公司	500,015.00	2.29%
8	彭云	495,000.00	2.27%
9	王家国	466,801.00	2.14%
10	姜新海	465,593.00	2.13%

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

截至本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 11 月 5 日）基金 份额总额	5,326,413,369.61
本报告期期初基金份额总额	5,213,405,911.30
本报告期基金总申购份额	631,834,423.60
减：本报告期基金总赎回份额	1,538,052,178.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,307,188,156.89

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 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

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及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

本报告期基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。



## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

## 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	
长城证券	2	1,552,736,278.46	74.43%	1,235,656.02	74.03%	-
渤海证券	1	533,568,071.33	25.57%	433,527.54	25.97%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
建银投资证券	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金

管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期内无新增或剔除交易单元。 4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 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		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
长城证券	735,417.50	100.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
建银投资证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 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	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28
2	关于开通建设银行借记卡基金网上交易业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28
3	关于旗下部分开放式基金通过中国工商银行开办基金定投业务暨参加基金定投优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-16
4	建信基金管理有限责任公司关于公司股权变更等相关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-09
5	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-28
6	关于旗下开放式基金通过中信证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-05
7	关于新增民生证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-04-21
8	关于参加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	指定报刊和/或公司网站	2011-03-30
9	关于旗下部分开放式基金参加海通证券网上交易系统基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-29
10	建信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的双汇发展估值方法变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-23
11	关于通过中信建投证券开办旗下部分开放式基金定投业务暨参加中信建投证券定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-17
12	关于旗下部分开放式基金参加中信建投证券网上交易系统基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-17
13	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-09

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；

- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年八月二十四日