

银华沪深 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：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 24 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.....	6
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.....	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.....	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.....	10
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对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指数投资组合.....	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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
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.....	43

§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
§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.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	银华沪深 300 指数(LOF)
基金主代码	161811
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009 年 10 月 14 日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	564,953,778.18 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	2009-10-30

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，追求跟踪误差最小化，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在沪深 300 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪沪深 300 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>如未来法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于股票指数期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，以使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后公告。</p> <p>本基金投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的组合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%。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率(税后)}$ 。
风险收益特征	本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其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		银华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	尹东
	联系电话	(010)58163000	(010) 67595003
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	(010) 67595096
传真		(010)58163027	(010) 66275853
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100738	100033
法定代表人		彭越	郭树清

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.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

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	1,932,193.64
本期利润	-12,876,203.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0239
本期加权平均净值利润率	-2.52%
本期基金份额净值增长率	-2.52%
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	-40,594,526.51

期末可供分配基金份额利润	-0.0719
期末基金资产净值	524,359,251.67
期末基金份额净值	0.928
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	-7.20%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的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：开放式基金认购、申购、赎回费，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

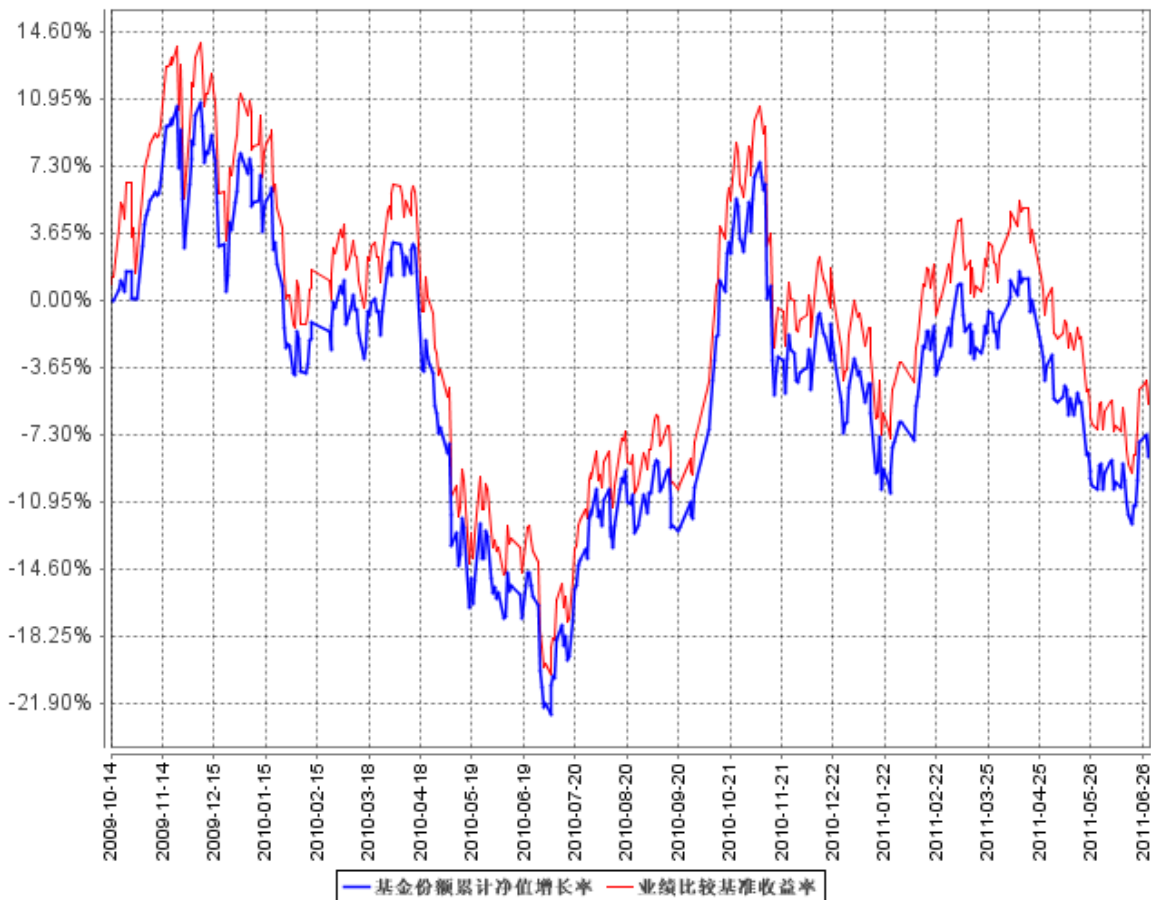
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.98%	1.14%	1.35%	1.13%	0.63%	0.01%
过去三个月	-4.72%	1.04%	-5.27%	1.04%	0.55%	0.00%
过去六个月	-2.52%	1.16%	-2.51%	1.17%	-0.01%	-0.01%
过去一年	17.62%	1.33%	17.91%	1.33%	-0.29%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-7.20%	1.39%	-4.34%	1.43%	-2.86%	-0.04%

注：由于本基金的投资标的为沪深 300 指数，且本基金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%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行活期存款利率（税后）。

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同第十二条：基金的投资（三）投资范围规定的各种比例，投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的组合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%。

§ 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

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性基金管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股权结构为西南证券股份有限公司（出资比例：29%）、第一创业证券有限责任公司（出资比例：29%）、东北证券股份有限公司（出资比例：21%）及山西海鑫实业股份有限公司（出资比例：21%）。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着十九只开放式证券投资基金和一只创新型封闭式证券投资基金，包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯

88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金和银华信用债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周毅先生	本基金的基金经理、公司境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监。	2010 年 6 月 21 日	-	12 年	硕士学位。毕业于北京大学，南卡罗莱纳大学，约翰霍普金斯大学。历任美国普华永道金融服务部经理，巴克莱银行量化分析部副总裁，巴克莱亚太有限公司副董事。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，自 2010 年 5 月 7 日起担任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2010 年 8 月 5 日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2010 年 12 月 6 日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)基金经理。具有从业资格。国籍：美国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，本基金管理人制定并执行了公平交易制度。公平交易制度的范围包括所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动。公平交易的执行情况包括：公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有公平的机会；实行集中交易制度和公平的交易分配制度；加强对投资交易行为的监察稽核力度等。综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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

注：本基金管理人旗下无其他投资风格与本基金相似的投资组合，因此未进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.928 元，本报告期份额净值增长率为-2.52%，同期业绩比较基准增长率为-2.51%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35%之内，年化跟踪误差控制在 4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在对通胀、增长、政策、资金等多种乐观预期的引领下，配合关于保障房的积极财政政策实施。整体来看，当前我国经济增速虽有回调，但幅度仍然缓和，在物价水平持续高企的背景下，上半年政策紧缩的调控节奏相当密集，同时需求结构和产业结构调整进展依然缓慢。

对于下半年，我们认为相比 6 月中下旬，农产品价格涨幅可能会明显收窄。其中猪肉价格涨幅回归常态的可能性较高，但由于前期猪肉价格涨幅较大，CPI 在近期内将处于较高的水平，近期涨幅较高的水产品预计后期涨幅也会回落。

我们认为 7 月 PMI 将会好于预期。但从绝对水平看，延续了 3 月以来偏弱的态势，需求即使

有所恢复，但也相对平淡。我们认为政策已进入观察期，规范化票据操作、以及高铁事故可能引发的财政投资放缓等，都引发了“暗紧”格局。预期后期流动性将维持偏紧格局，各层面利率处于高位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：银华沪深 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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	28,611,656.13	25,898,717.56
结算备付金		70,256.07	396,802.16
存出保证金		125,277.82	21,147.24
交易性金融资产	6.4.7.2	495,315,687.52	443,184,220.68
其中：股票投资		495,315,687.52	443,184,220.68
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		-	2,456,442.10
应收利息	6.4.7.5	5,439.81	7,661.92
应收股利		674,604.72	-
应收申购款		336,806.27	732,727.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		525,139,728.34	472,697,719.11
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		209,784.75	32,580.39
应付管理人报酬		209,795.17	218,813.84
应付托管费		62,938.56	65,644.18

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	94,081.72	332,051.40
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	203,876.47	50,092.16
负债合计		780,476.67	699,181.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	564,953,778.18	495,740,616.48
未分配利润	6.4.7.10	-40,594,526.51	-23,742,079.34
所有者权益合计		524,359,251.67	471,998,537.14
负债和所有者权益总计		525,139,728.34	472,697,719.11

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.928 元，基金份额总额 564,953,778.18 份。

6.2 利润表

会计主体：银华沪深 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
一、收入		-10,274,843.07	-168,906,828.11
1. 利息收入		112,999.64	154,870.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	112,999.64	154,870.38
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,300,101.39	667,521.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-221,544.35	-2,892,999.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	4,521,645.74	3,560,521.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-14,808,396.94	-170,137,161.58
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	120,452.84	407,941.15
二、费用		2,601,360.23	2,625,052.63

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,266,167.60	1,413,352.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	379,850.32	424,005.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	740,548.20	548,496.65
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	214,794.11	239,197.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,876,203.30	-171,531,880.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,876,203.30	-171,531,880.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华沪深 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）	495,740,616.48	-23,742,079.34	471,998,537.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,876,203.30	-12,876,203.30
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）	69,213,161.70	-3,976,243.87	65,236,917.83
其中：1. 基金申购款	200,718,484.83	-6,679,063.50	194,039,421.33
2. 基金赎回款	-131,505,323.13	2,702,819.63	-128,802,503.50
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）	564,953,778.18	-40,594,526.51	524,359,251.67
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）	580,639,981.57	46,672,379.83	627,312,361.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-171,531,880.74	-171,531,880.74
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）	48,398,709.61	-7,647,859.54	40,750,850.07
其中：1. 基金申购款	378,019,125.08	-10,920,298.59	367,098,826.49
2. 基金赎回款	-329,620,415.47	3,272,439.05	-326,347,976.42
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）	629,038,691.18	-132,507,360.45	496,531,330.73

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

基金管理公司负责人

陈建军

主管会计工作负责人

龚飒

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华沪深 300 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]793 号文《关于核准银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由银华基金管理有限公司依照《基金法》、基金合同及其他有关规定于 2009 年 9 月 4 日至 2009 年 9 月 30 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009)验字第 60468687_A03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2009 年 10 月 14 日生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 669,901,627.47 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 287,478.28 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 670,189,105.75 元，折合 670,189,105.75 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的组合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%。在保证流动性的前提下，如果法律法规允许，在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准选定为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2011 年 06 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更的说明。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司及债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金

等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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	28,611,656.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	28,611,656.13

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	529,122,684.67	495,315,687.52	-33,806,997.15
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	529,122,684.67	495,315,687.52	-33,806,997.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于 2011 年 06 月 30 日未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于 2011 年 06 月 30 日未持有买入返售金融资产。

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	5,402.97

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	31.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5.24
其他	-
合计	5,439.81

6.4.7.6 其他资产

本基金于 2011 年 6 月 30 日无需要说明的其他资产。

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	94,081.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	94,081.72

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	562.79
预提费用	203,313.68
合计	203,876.47

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	495,740,616.48	495,740,616.48
本期申购	200,718,484.83	200,718,484.83
本期赎回(以“-”号填列)	-131,505,323.13	-131,505,323.13
本期末	564,953,778.18	564,953,778.18

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

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	-1,467,837.18	-22,274,242.16	-23,742,079.34
本期利润	1,932,193.64	-14,808,396.94	-12,876,203.30
本期基金份额交易产生的变动数	-395,111.82	-3,581,132.05	-3,976,243.87
其中：基金申购款	-1,103,846.63	-5,575,216.87	-6,679,063.50
基金赎回款	708,734.81	1,994,084.82	2,702,819.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,244.64	-40,663,771.15	-40,594,526.51

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	107,491.97
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	3,382.81
其他	2,124.86
合计	112,999.64

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	219,267,873.67
减：卖出股票成本总额	219,489,418.02
买卖股票差价收入	-221,544.35

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未发生衍生工具收益。

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	4,521,645.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,521,645.74

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	-14,808,396.94
——股票投资	-14,808,396.94
——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	-14,808,396.94

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	120,452.84
合计	120,452.84

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	740,548.20
银行间市场交易费用	-
合计	740,548.20

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	24,795.19
信息披露费	148,765.71
上市费	29,752.78
银行汇划费用	2,480.43
账户服务费	9,000.00
合计	214,794.11

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券有限责任公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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 1 月 1 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
第一创业	1,643,483.25	0.33%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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
第一创业	1,397.11	0.33%	1,397.11	1.48%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	1,266,167.60
其中：支付销售机构的客户维护费	311,977.70	371,280.81

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	379,850.32

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

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

本基金本报告期末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

本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金份额。

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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		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
中国建设银行	28,611,656.13	107,491.97	30,432,608.25	144,027.90

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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
600216	浙江医药	2011 年 6 月 27 日	非公开发行股票	31.39	2011 年 7 月 4 日	32.60	24,743	865,684.48	776,682.77	-
000876	新希望	2011 年 6 月 29 日	重大资产重组	19.95	2011 年 7 月 5 日	21.95	38,153	678,374.97	761,152.35	-
000652	泰达股份	2010 年 11 月 22 日	筹划重大事项	7.68	2011 年 7 月 8 日	7.68	94,815	764,551.57	728,179.20	-
600170	上海建工	2011 年 6 月 29 日	重大资产重组	15.59	2011 年 7 月 4 日	16.25	38,044	610,684.49	593,105.96	-
000959	首钢股份	2010 年 10 月 29 日	重大资产重组	4.42	未知	未知	119,296	574,833.57	527,288.32	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

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，除在 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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	28,611,656.13	-	-	-	-	28,611,656.13
结算备付金	70,256.07	-	-	-	-	70,256.07
存出保证金	-	-	-	-	125,277.82	125,277.82
交易性金融资产	-	-	-	-	495,315,687.52	495,315,687.52
应收利息	-	-	-	-	5,439.81	5,439.81

应收股利	-	-	-	-	674,604.72	674,604.72
应收申购款	44,284.30	-	-	-	292,521.97	336,806.27
资产总计	28,726,196.50	-	-	-	496,413,531.84	525,139,728.34
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	209,784.75	209,784.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	209,795.17	209,795.17
应付托管费	-	-	-	-	62,938.56	62,938.56
应付交易费用	-	-	-	-	94,081.72	94,081.72
其他负债	-	-	-	-	203,876.47	203,876.47
负债总计	-	-	-	-	780,476.67	780,476.67
利率敏感度缺口	28,726,196.50	-	-	-	495,633,055.17	524,359,251.67
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	25,898,717.56	-	-	-	-	25,898,717.56
结算备付金	396,802.16	-	-	-	-	396,802.16
存出保证金	-	-	-	-	21,147.24	21,147.24
交易性金融资产	-	-	-	-	443,184,220.68	443,184,220.68
应收证券清算款	-	-	-	-	2,456,442.10	2,456,442.10
应收利息	-	-	-	-	7,661.92	7,661.92
应收申购款	10,326.14	-	-	-	722,401.31	732,727.45
资产总计	26,305,845.86	-	-	-	446,391,873.25	472,697,719.11
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	32,580.39	32,580.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	218,813.84	218,813.84
应付托管费	-	-	-	-	65,644.18	65,644.18
应付交易费用	-	-	-	-	332,051.40	332,051.40
其他负债	-	-	-	-	50,092.16	50,092.16
负债总计	-	-	-	-	699,181.97	699,181.97
利率敏感度缺口	26,305,845.86	-	-	-	445,692,691.28	471,998,537.14

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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

注：本基金在 2011 年 6 月 30 日及 2010 年末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的组合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%。在保证流动性的前提下，如果法律法规允许，在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。于 2011 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	495,315,687.52	94.46	443,184,220.68	93.90
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	495,315,687.52	94.46	443,184,220.68	93.90

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	+5%	26,007,015.79	23,350,631.11
	-5%	-26,007,015.79	-23,350,631.11

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	495,315,687.52	94.32
	其中：股票	495,315,687.52	94.32
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	28,681,912.20	5.46
6	其他各项资产	1,142,128.62	0.22
7	合计	525,139,728.34	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	1,650,728.65	0.31
B	采掘业	58,738,837.32	11.20
C	制造业	178,018,646.56	33.95
C0	食品、饮料	29,262,317.76	5.58
C1	纺织、服装、皮毛	1,746,955.98	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,739,120.05	2.24

C5	电子	4,252,061.63	0.81
C6	金属、非金属	45,963,192.74	8.77
C7	机械、设备、仪表	63,988,567.69	12.20
C8	医药、生物制品	19,847,941.11	3.79
C99	其他制造业	1,218,489.60	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,313,948.96	2.16
E	建筑业	15,328,018.98	2.92
F	交通运输、仓储业	19,218,303.57	3.67
G	信息技术业	15,980,720.42	3.05
H	批发和零售贸易	13,902,797.73	2.65
I	金融、保险业	134,125,750.50	25.58
J	房地产业	25,527,247.90	4.87
K	社会服务业	4,476,597.36	0.85
L	传播与文化产业	580,483.54	0.11
M	综合类	10,392,107.03	1.98
	合计	489,254,188.52	93.31

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	649,798.00	0.12
B	采掘业	234,088.00	0.04
C	制造业	3,191,919.00	0.61
C0	食品、饮料	454,480.00	0.09
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	299,633.00	0.06
C5	电子	619,592.00	0.12
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,388,804.00	0.26
C8	医药、生物制品	429,410.00	0.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	234,000.00	0.04
F	交通运输、仓储业	358,720.00	0.07
G	信息技术业	95,404.00	0.02
H	批发和零售贸易	315,213.00	0.06
I	金融、保险业	524,689.00	0.10

J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	224,908.00	0.04
M	综合类	232,760.00	0.04
	合计	6,061,499.00	1.16

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	601318	中国平安	300,528	14,506,486.56	2.77
2	600036	招商银行	1,109,430	14,444,778.60	2.75
3	600016	民生银行	2,026,306	11,610,733.38	2.21
4	601398	工商银行	2,344,189	10,455,082.94	1.99
5	601328	交通银行	1,867,301	10,344,847.54	1.97
6	600000	浦发银行	1,004,011	9,879,468.24	1.88
7	601166	兴业银行	677,416	9,131,567.68	1.74
8	601088	中国神华	295,870	8,917,521.80	1.70
9	600030	中信证券	624,544	8,169,035.52	1.56
10	000002	万科A	868,527	7,339,053.15	1.40
11	600519	贵州茅台	33,858	7,199,226.54	1.37
12	601601	中国太保	282,005	6,314,091.95	1.20
13	000858	五粮液	170,227	6,080,508.44	1.16
14	600837	海通证券	587,052	5,295,209.04	1.01
15	600585	海螺水泥	179,411	4,980,449.36	0.95
16	600031	三一重工	272,520	4,916,260.80	0.94
17	601668	中国建筑	1,207,752	4,867,240.56	0.93
18	002024	苏宁电器	376,594	4,824,169.14	0.92
19	600111	包钢稀土	65,174	4,655,378.82	0.89
20	601006	大秦铁路	533,429	4,368,783.51	0.83
21	000001	深发展A	250,033	4,268,063.31	0.81
22	000651	格力电器	176,950	4,158,325.00	0.79
23	600050	中国联通	760,718	3,993,769.50	0.76
24	601169	北京银行	391,018	3,898,449.46	0.74
25	601857	中国石油	337,079	3,670,790.31	0.70
26	000157	中联重科	237,635	3,654,826.30	0.70
27	000063	中兴通讯	125,992	3,563,053.76	0.68

28	600048	保利地产	320,061	3,517,470.39	0.67
29	601899	紫金矿业	472,725	3,422,529.00	0.65
30	000983	西山煤电	141,350	3,420,670.00	0.65
31	601989	中国重工	247,281	3,410,004.99	0.65
32	000527	美的电器	182,154	3,349,812.06	0.64
33	601288	农业银行	1,145,184	3,206,515.20	0.61
34	600900	长江电力	444,116	3,202,076.36	0.61
35	600104	上海汽车	165,800	3,107,092.00	0.59
36	600028	中国石化	373,470	3,073,658.10	0.59
37	600089	特变电工	236,426	3,059,352.44	0.58
38	000792	盐湖股份	49,794	2,937,846.00	0.56
39	600547	山东黄金	63,837	2,862,451.08	0.55
40	600019	宝钢股份	471,304	2,841,963.12	0.54
41	000338	潍柴动力	62,103	2,821,339.29	0.54
42	000568	泸州老窖	62,494	2,819,729.28	0.54
43	601699	潞安环能	82,483	2,706,267.23	0.52
44	600015	华夏银行	245,783	2,671,661.21	0.51
45	600362	江西铜业	74,481	2,639,606.64	0.50
46	600348	国阳新能	107,903	2,604,778.42	0.50
47	600383	金地集团	401,281	2,572,211.21	0.49
48	601628	中国人寿	134,520	2,522,250.00	0.48
49	601766	中国南车	352,267	2,508,141.04	0.48
50	600256	广汇股份	104,795	2,492,025.10	0.48
51	600887	伊利股份	143,363	2,386,993.95	0.46
52	601168	西部矿业	160,017	2,371,451.94	0.45
53	601600	中国铝业	213,776	2,353,673.76	0.45
54	000783	长江证券	215,701	2,323,099.77	0.44
55	600739	辽宁成大	81,594	2,268,313.20	0.43
56	600489	中金黄金	82,940	2,263,432.60	0.43
57	600795	国电电力	761,434	2,253,844.64	0.43
58	600068	葛洲坝	187,603	2,249,359.97	0.43
59	600690	青岛海尔	73,866	2,064,554.70	0.39
60	600406	国电南瑞	56,462	2,049,570.60	0.39
61	600999	招商证券	111,374	2,047,054.12	0.39
62	002304	洋河股份	15,892	2,004,934.72	0.38
63	601299	中国北车	297,958	1,996,318.60	0.38
64	000069	华侨城 A	251,042	1,985,742.22	0.38
65	601988	中国银行	625,231	1,963,225.34	0.37
66	000423	东阿阿胶	46,928	1,936,249.28	0.37

67	600010	包钢股份	230,446	1,924,224.10	0.37
68	000776	广发证券	48,122	1,888,788.50	0.36
69	600188	兖州煤业	53,115	1,874,959.50	0.36
70	600518	康美药业	141,397	1,860,784.52	0.35
71	601390	中国中铁	459,810	1,834,641.90	0.35
72	000425	徐工机械	73,974	1,833,815.46	0.35
73	600309	烟台万华	96,966	1,814,233.86	0.35
74	000895	双汇发展	27,197	1,796,905.79	0.34
75	002202	金风科技	118,376	1,767,353.68	0.34
76	000009	中国宝安	100,099	1,723,704.78	0.33
77	000060	中金岭南	129,549	1,723,001.70	0.33
78	601618	中国中冶	436,872	1,721,275.68	0.33
79	601919	中国远洋	205,368	1,702,500.72	0.32
80	000039	中集集团	77,393	1,693,358.84	0.32
81	601788	光大证券	122,636	1,686,245.00	0.32
82	000709	河北钢铁	370,647	1,675,324.44	0.32
83	601009	南京银行	186,407	1,672,070.79	0.32
84	601186	中国铁建	276,184	1,670,913.20	0.32
85	601958	金钼股份	86,783	1,670,572.75	0.32
86	601898	中煤能源	164,256	1,642,560.00	0.31
87	000402	金融街	217,554	1,625,128.38	0.31
88	000937	冀中能源	62,208	1,576,972.80	0.30
89	000012	南玻A	93,600	1,544,400.00	0.29
90	601688	华泰证券	125,017	1,543,959.95	0.29
91	000630	铜陵有色	63,759	1,536,591.90	0.29
92	600150	中国船舶	20,729	1,533,738.71	0.29
93	600875	东方电气	59,681	1,521,865.50	0.29
94	000623	吉林敖东	49,376	1,521,274.56	0.29
95	600276	恒瑞医药	50,445	1,511,836.65	0.29
96	600005	武钢股份	361,953	1,502,104.95	0.29
97	600415	小商品城	122,012	1,499,527.48	0.29
98	600132	重庆啤酒	26,015	1,493,261.00	0.28
99	601666	平煤股份	105,867	1,483,196.67	0.28
100	600029	南方航空	189,148	1,482,920.32	0.28
101	601607	上海医药	86,244	1,448,899.20	0.28
102	601111	中国国航	149,345	1,432,218.55	0.27
103	000538	云南白药	24,909	1,421,805.72	0.27
104	600881	亚泰集团	169,986	1,415,983.38	0.27
105	000401	冀东水泥	55,631	1,390,218.69	0.27

106	000933	神火股份	90,428	1,375,409.88	0.26
107	000528	柳 工	60,554	1,370,337.02	0.26
108	000100	TCL 集团	455,940	1,363,260.60	0.26
109	000725	京东方 A	490,765	1,339,788.45	0.26
110	600058	五矿发展	38,440	1,317,723.20	0.25
111	000825	太钢不锈	255,644	1,316,566.60	0.25
112	600100	同方股份	124,804	1,305,449.84	0.25
113	600660	福耀玻璃	125,675	1,301,993.00	0.25
114	600497	驰宏锌锗	58,730	1,294,996.50	0.25
115	600642	申能股份	254,606	1,290,852.42	0.25
116	600123	兰花科创	30,707	1,282,938.46	0.24
117	600143	金发科技	75,136	1,236,738.56	0.24
118	000878	云南铜业	56,400	1,235,724.00	0.24
119	000768	西飞国际	111,186	1,224,157.86	0.23
120	601727	上海电气	176,732	1,222,985.44	0.23
121	000758	中色股份	34,325	1,213,388.75	0.23
122	600177	雅戈尔	119,826	1,182,682.62	0.23
123	000960	锡业股份	40,625	1,182,187.50	0.23
124	601117	中国化学	132,643	1,175,216.98	0.22
125	600271	航天信息	45,416	1,173,549.44	0.22
126	601106	中国一重	234,827	1,138,910.95	0.22
127	600832	东方明珠	146,358	1,134,274.50	0.22
128	000024	招商地产	61,771	1,130,409.30	0.22
129	000898	鞍钢股份	165,628	1,126,270.40	0.21
130	002142	宁波银行	103,434	1,125,361.92	0.21
131	600655	豫园商城	103,137	1,122,130.56	0.21
132	600583	海油工程	174,394	1,119,609.48	0.21
133	600115	东方航空	214,930	1,117,636.00	0.21
134	600550	天威保变	61,563	1,108,749.63	0.21
135	600009	上海机场	86,351	1,105,292.80	0.21
136	000778	新兴铸管	103,279	1,089,593.45	0.21
137	600153	建发股份	120,388	1,071,453.20	0.20
138	600600	青岛啤酒	31,208	1,065,441.12	0.20
139	000800	一汽轿车	74,738	1,058,290.08	0.20
140	600320	振华重工	158,338	1,052,947.70	0.20
141	600664	哈药股份	66,926	1,050,738.20	0.20
142	601333	广深铁路	253,599	1,042,291.89	0.20
143	600741	华域汽车	92,664	1,031,350.32	0.20
144	601001	大同煤业	60,066	1,021,122.00	0.19

145	000422	湖北宣化	48,680	1,018,872.40	0.19
146	600549	厦门钨业	24,491	1,014,662.13	0.19
147	600694	大商股份	26,336	1,006,825.28	0.19
148	600166	福田汽车	113,466	984,884.88	0.19
149	600395	盘江股份	29,653	984,183.07	0.19
150	601818	光大银行	287,501	963,128.35	0.18
151	002155	辰州矿业	29,399	961,053.31	0.18
152	000680	山推股份	54,411	957,089.49	0.18
153	600535	天士力	23,144	951,912.72	0.18
154	601808	中海油服	53,073	947,883.78	0.18
155	600196	复星医药	85,426	929,434.88	0.18
156	000729	燕京啤酒	54,278	921,097.66	0.18
157	000969	安泰科技	46,120	900,723.60	0.17
158	600219	南山铝业	95,328	897,036.48	0.17
159	600598	北大荒	63,845	893,830.00	0.17
160	600970	中材国际	32,651	892,351.83	0.17
161	601101	昊华能源	14,134	891,996.74	0.17
162	600376	首开股份	67,136	886,866.56	0.17
163	600997	开滦股份	55,332	883,098.72	0.17
164	600169	太原重工	86,981	882,857.15	0.17
165	600352	浙江龙盛	92,146	882,758.68	0.17
166	600631	百联股份	59,224	881,253.12	0.17
167	000839	中信国安	84,323	877,802.43	0.17
168	002007	华兰生物	25,832	876,738.08	0.17
169	000562	宏源证券	52,365	875,019.15	0.17
170	600125	铁龙物流	82,034	864,638.36	0.16
171	002001	新和成	29,220	860,529.00	0.16
172	600208	新湖中宝	137,968	859,540.64	0.16
173	000625	长安汽车	93,788	858,160.20	0.16
174	600812	华北制药	73,790	850,060.80	0.16
175	600703	三安光电	51,828	849,979.20	0.16
176	600649	城投控股	103,142	837,513.04	0.16
177	600418	江淮汽车	75,037	833,661.07	0.16
178	600085	同仁堂	23,377	833,623.82	0.16
179	601179	中国西电	136,270	831,247.00	0.16
180	600316	洪都航空	25,729	829,245.67	0.16
181	600811	东方集团	119,564	822,600.32	0.16
182	600809	山西汾酒	11,615	813,630.75	0.16
183	600582	天地科技	36,334	804,434.76	0.15

184	600331	宏达股份	59,983	798,373.73	0.15
185	000728	国元证券	70,474	796,356.20	0.15
186	601866	中海集运	213,652	777,693.28	0.15
187	002128	露天煤业	35,733	777,192.75	0.15
188	600216	浙江医药	24,743	776,682.77	0.15
189	000061	农产品	48,103	767,723.88	0.15
190	600062	双鹤药业	30,780	763,036.20	0.15
191	000876	新希望	38,153	761,152.35	0.15
192	002422	科伦药业	12,895	760,805.00	0.15
193	600221	海南航空	106,206	758,310.84	0.14
194	600108	亚盛集团	124,695	756,898.65	0.14
195	600588	用友软件	36,548	755,081.68	0.14
196	600066	宇通客车	32,630	755,058.20	0.14
197	600804	鹏博士	95,550	753,889.50	0.14
198	600516	方大炭素	57,383	753,438.79	0.14
199	600839	四川长虹	223,727	747,248.18	0.14
200	600808	马钢股份	213,892	744,344.16	0.14
201	600018	上港集团	190,628	743,449.20	0.14
202	000059	辽通化工	53,907	732,057.06	0.14
203	000652	泰达股份	94,815	728,179.20	0.14
204	601158	重庆水务	86,179	711,838.54	0.14
205	600118	中国卫星	31,579	707,685.39	0.13
206	600879	航天电子	58,149	707,091.84	0.13
207	600635	大众公用	118,057	696,536.30	0.13
208	600779	水井坊	30,625	686,612.50	0.13
209	000807	云铝股份	63,796	686,444.96	0.13
210	600595	中孚实业	67,927	681,987.08	0.13
211	002092	中泰化学	51,937	681,413.44	0.13
212	600893	航空动力	38,897	672,529.13	0.13
213	600239	云南城投	51,755	665,569.30	0.13
214	600895	张江高科	69,490	655,985.60	0.13
215	600432	吉恩镍业	29,186	650,264.08	0.12
216	600500	中化国际	64,385	643,206.15	0.12
217	600508	上海能源	25,967	632,815.79	0.12
218	000999	华润三九	35,153	630,996.35	0.12
219	600546	山煤国际	20,177	629,320.63	0.12
220	600717	天津港	75,147	614,702.46	0.12
221	002122	天马股份	47,725	610,880.00	0.12
222	601918	国投新集	49,823	605,847.68	0.12

223	600675	中华企业	88,705	603,194.00	0.12
224	600266	北京城建	39,944	601,157.20	0.11
225	600312	平高电气	58,714	595,947.10	0.11
226	600170	上海建工	38,044	593,105.96	0.11
227	000968	煤气化	23,052	583,907.16	0.11
228	600037	歌华有线	56,966	580,483.54	0.11
229	000780	平庄能源	36,359	578,108.10	0.11
230	002146	荣盛发展	58,728	575,534.40	0.11
231	002399	海普瑞	14,712	569,501.52	0.11
232	600528	中铁二局	65,350	567,891.50	0.11
233	600220	江苏阳光	111,959	564,273.36	0.11
234	600428	中远航运	77,847	562,055.34	0.11
235	601888	中国国旅	23,718	560,456.34	0.11
236	600718	东软集团	49,157	559,406.66	0.11
237	600008	首创股份	98,625	558,217.50	0.11
238	600456	宝钛股份	19,281	556,449.66	0.11
239	000690	宝新能源	108,618	545,262.36	0.10
240	000612	焦作万方	30,185	538,500.40	0.10
241	000027	深圳能源	71,000	535,340.00	0.10
242	000959	首钢股份	119,296	527,288.32	0.10
243	600481	双良节能	36,304	524,955.84	0.10
244	600096	云天化	24,909	495,440.01	0.09
245	600269	赣粤高速	104,856	493,871.76	0.09
246	000021	长城开发	59,154	489,795.12	0.09
247	000718	苏宁环球	61,174	489,392.00	0.09
248	000951	中国重汽	26,251	485,118.48	0.09
249	600674	川投能源	33,446	479,615.64	0.09
250	600026	中海发展	56,722	478,733.68	0.09
251	600863	内蒙华电	53,332	472,521.52	0.09
252	000031	中粮地产	81,412	465,676.64	0.09
253	600737	中粮屯河	45,163	462,920.75	0.09
254	600823	世茂股份	31,518	461,108.34	0.09
255	600183	生益科技	49,024	450,040.32	0.09
256	002244	滨江集团	36,292	446,391.60	0.09
257	600151	航天机电	38,510	444,020.30	0.08
258	600380	健康元	47,172	434,454.12	0.08
259	600307	酒钢宏兴	73,316	401,771.68	0.08
260	600517	置信电气	33,232	401,110.24	0.08
261	600161	天坛生物	23,157	392,511.15	0.07

262	600109	国金证券	26,970	392,413.50	0.07
263	600300	维维股份	75,034	386,425.10	0.07
264	600601	方正科技	100,991	361,547.78	0.07
265	002415	海康威视	8,952	351,724.08	0.07
266	600325	华发股份	30,095	337,665.90	0.06
267	000961	中南建设	31,317	330,081.18	0.06
268	601268	二重重装	30,348	328,972.32	0.06
269	601107	四川成渝	58,221	327,202.02	0.06
270	002294	信立泰	9,723	326,595.57	0.06
271	600004	白云机场	41,265	325,580.85	0.06
272	002028	思源电气	23,617	323,316.73	0.06
273	601369	陕鼓动力	29,459	323,165.23	0.06
274	600210	紫江企业	52,961	317,766.00	0.06
275	000927	一汽夏利	42,872	302,676.32	0.06
276	000046	泛海建设	31,254	274,410.12	0.05
277	002405	四维图新	8,601	267,921.15	0.05
278	000685	中山公用	16,046	267,005.44	0.05
279	600663	陆家嘴	18,724	261,761.52	0.05
280	600017	日照港	60,406	251,288.96	0.05
281	000667	名流置业	81,948	245,024.52	0.05
282	002385	大北农	7,147	231,562.80	0.04
283	600596	新安股份	21,792	229,251.84	0.04
284	600087	长航油运	78,283	227,803.53	0.04
285	000900	现代投资	12,881	209,960.30	0.04
286	600033	福建高速	62,924	203,873.76	0.04
287	600611	大众交通	28,712	196,964.32	0.04
288	600006	东风汽车	36,881	161,538.78	0.03
289	601877	正泰电器	9,283	160,874.39	0.03
290	600597	光明乳业	19,157	151,915.01	0.03
291	600748	上实发展	19,908	144,133.92	0.03
292	600657	信达地产	21,143	134,680.91	0.03
293	601099	太平洋	13,884	130,787.28	0.02
294	002242	九阳股份	10,436	130,450.00	0.02
295	600350	山东高速	30,796	127,495.44	0.02
296	601139	深圳燃气	11,307	118,497.36	0.02

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	002073	软控股份	32,500	669,500.00	0.13
2	002106	莱宝高科	15,800	477,950.00	0.09
3	000869	张裕A	4,600	454,480.00	0.09
4	600267	海正药业	11,500	429,410.00	0.08
5	601118	海南橡胶	34,400	423,808.00	0.08
6	601018	宁波港	112,100	358,720.00	0.07
7	601377	兴业证券	19,300	332,539.00	0.06
8	002493	荣盛石化	9,700	299,633.00	0.06
9	000559	万向钱潮	34,900	280,596.00	0.05
10	600971	恒源煤电	5,800	234,088.00	0.04
11	002310	东方园林	2,600	234,000.00	0.04
12	601718	际华集团	50,600	232,760.00	0.04
13	002069	獐子岛	9,300	225,990.00	0.04
14	601098	中南传媒	23,600	224,908.00	0.04
15	601717	郑煤机	6,100	222,406.00	0.04
16	601558	华锐风电	7,400	216,302.00	0.04
17	002500	山西证券	21,000	192,150.00	0.04
18	601933	永辉超市	6,700	162,073.00	0.03
19	600998	九州通	12,400	153,140.00	0.03
20	000536	华映科技	6,100	141,642.00	0.03
21	601519	大智慧	6,100	95,404.00	0.02

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	601318	中国平安	5,147,892.08	1.09
2	600036	招商银行	4,768,270.43	1.01
3	600000	浦发银行	4,442,783.37	0.94
4	600016	民生银行	3,574,718.00	0.76
5	600887	伊利股份	3,518,917.27	0.75
6	601398	工商银行	3,513,098.08	0.74
7	601328	DR 交通银	3,463,219.17	0.73
8	601166	兴业银行	3,460,057.12	0.73

9	600837	海通证券	3,087,177.01	0.65
10	601088	中国神华	3,055,150.89	0.65
11	000776	广发证券	2,765,039.94	0.59
12	600406	国电南瑞	2,708,894.50	0.57
13	000002	万科A	2,668,750.00	0.57
14	600030	中信证券	2,591,851.00	0.55
15	600585	海螺水泥	2,477,901.43	0.52
16	600276	恒瑞医药	2,450,484.38	0.52
17	600132	重庆啤酒	2,201,219.99	0.47
18	601106	中国一重	2,185,726.01	0.46
19	600519	贵州茅台	2,096,236.28	0.44
20	601601	中国太保	2,030,531.62	0.43

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	4,251,251.69	0.90
2	600036	招商银行	3,745,914.94	0.79
3	600016	民生银行	2,947,918.70	0.62
4	601328	DR 交通银	2,781,448.89	0.59
5	601166	兴业银行	2,770,492.37	0.59
6	601398	工商银行	2,724,775.83	0.58
7	601088	中国神华	2,477,738.17	0.52
8	600000	浦发银行	2,268,967.39	0.48
9	000002	万科A	2,245,675.30	0.48
10	600132	重庆啤酒	2,123,428.48	0.45
11	000063	中兴通讯	2,036,936.03	0.43
12	600900	长江电力	2,028,181.56	0.43
13	600030	中信证券	1,912,471.10	0.41
14	600018	上港集团	1,765,675.74	0.37
15	000069	华侨城A	1,701,244.38	0.36
16	600519	贵州茅台	1,671,922.42	0.35
17	601601	中国太保	1,634,991.99	0.35
18	000858	五粮液	1,536,455.53	0.33
19	600011	华能国际	1,478,401.37	0.31

20	601766	中国南车	1,450,302.62	0.31
----	--------	------	--------------	------

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	286,429,281.80
卖出股票收入（成交）总额	219,267,873.67

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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不存在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没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

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	125,277.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	674,604.72
4	应收利息	5,439.81
5	应收申购款	336,806.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,142,128.62
---	----	--------------

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
16,927	33,375.90	120,107,285.26	21.26%	444,846,492.92	78.74%

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	邵云娟	5,039,314.00	22.27%
2	吴晶蓉	2,500,000.00	11.05%
3	红塔证券股份有限公司	2,003,155.00	8.85%
4	张元中	331,400.00	1.46%
5	黄国序	300,000.00	1.33%
6	余红旗	300,000.00	1.33%
7	罗恩华	261,200.00	1.15%
8	郭晓宇	246,033.00	1.09%
9	俞霞	231,900.00	1.02%
10	王碧玲	207,504.00	0.92%

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	53,184.07	0.01%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 10 月 14 日) 基金份额总额	670,189,105.75
本报告期期初基金份额总额	495,740,616.48
本报告期基金总申购份额	200,718,484.83
减:本报告期基金总赎回份额	131,505,323.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	564,953,778.18

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1.1 2011 年 1 月 8 日，本基金管理人发布关于公司副总经理离任的公告，经本公司董事会批准，魏瑛女士自 2011 年 1 月 7 日起不再担任本基金管理人公司副总经理职务。该变更事项已向相关监管部门备案；

10.2.1.2 2011 年 2 月 1 日，本基金管理人发布关于公司副总经理离任的公告，经本公司董事会批准，石松鹰先生自 2011 年 1 月 31 日起不再担任本基金管理人公司副总经理职务。该变更事项已向相关监管部门备案；

10.2.1.3 2011 年 5 月 17 日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，经本公司董事会批准并经中国证监会核准，公司聘任陆文俊先生自 2011 年 5 月 13 日起担任本基金管理人公司副总经理职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.2.1 本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务;

10.2.2.2 本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可(2011)115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,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

本基金本报告期内未变更为基金进行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

本报告期内,基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
安信证券股份有限公司	3	84,536,417.23	16.75%	71,856.28	16.95%	-
国都证券有限责任公司	2	72,941,966.70	14.45%	60,253.11	14.21%	新增 2 个交易单元
长江证券股份有限公司	2	53,811,200.31	10.66%	45,433.00	10.72%	-
上海证券有限责任公司	1	50,438,742.68	9.99%	42,873.08	10.11%	-
中信证券股份有限公司	3	42,518,086.63	8.42%	34,546.32	8.15%	-

光大证券股份有限公司	2	38,022,694.58	7.53%	32,319.16	7.62%	-
西部证券股份有限公司	1	29,295,267.01	5.80%	24,900.91	5.87%	-
广发证券股份有限公司	1	24,473,984.24	4.85%	20,802.91	4.91%	-
方正证券有限责任公司	1	22,586,170.45	4.47%	19,198.10	4.53%	-
中国国际金融有限公司	2	19,346,690.11	3.83%	15,719.39	3.71%	-
中国民族证券有限责任公司	1	15,298,319.86	3.03%	13,003.67	3.07%	-
兴业证券股份有限公司	3	11,263,751.62	2.23%	9,151.98	2.16%	-
华融证券股份有限公司	1	9,767,761.30	1.93%	8,302.92	1.96%	新增 1 个交易单元
国信证券股份有限公司	2	9,125,177.83	1.81%	7,414.14	1.75%	新增 2 个交易单元
华宝证券有限责任公司	1	8,660,794.63	1.72%	7,361.94	1.74%	-
国金证券股份有限公司	2	4,755,137.93	0.94%	4,042.15	0.95%	-
齐鲁证券有限公司	1	3,088,419.89	0.61%	2,625.30	0.62%	-
中银国际证券有限责任公司	3	2,694,373.36	0.53%	2,239.33	0.53%	-
第一创业证券有限责任公司	2	1,643,483.25	0.33%	1,397.11	0.33%	-
华创证券股份有限公司	2	535,522.44	0.11%	435.05	0.10%	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
山西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	3	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	3	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

宏源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内未通过交易单元进行债券、回购及权证交易。

2、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

3、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

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	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年6月29日
2	《银华基金管理有限公司关于提醒投资者防范非法证券活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年6月16日
3	《银华基金管理有限公司关于增加英大证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年6月8日
4	《银华沪深300指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书及摘要(2011年第1号)》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年5月28日
5	《银华基金管理有限公司关于增加浙商证券为旗下部分基金代销及定期定额投资业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年5月26日
6	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年5月17日
7	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年5月6日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011年4月28日

9	《关于增加华融证券为旗下部分基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 27 日
10	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2011 年第 1 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 20 日
11	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在西南证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 12 日
12	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 1 日
13	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人网上银行费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 31 日
14	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2010 年年度报告及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 30 日
15	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券网上费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 21 日
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 15 日
17	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 8 日
18	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券网上申购业务费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 3 日
19	《银华基金管理有限公司关于对公司旗下基金持有的停牌股票进行估值方法调整的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 22 日
20	《银华基金管理有限公司关于增加重庆银行为旗下基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 16 日
21	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海农商银行开通代销等业务及参加费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 9 日
22	《银华基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 1 日
23	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2010 年第 4 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2011 年 1 月 22 日

		http://www.yhfund.com.cn	
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在天相投顾开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 22 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在德邦证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 17 日
26	《银华基金管理有限公司关于推出基金手机交易与查询业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
27	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通基金赎回转认/申购业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
28	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通定期定额赎回业务和定期定额转换业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
29	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通现金宝业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
30	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通定期不定额申购业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
31	《银华基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 8 日
32	《银华基金管理有限公司 2010 年 12 月 31 日基金净值公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 4 日

§ 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

- 12.1.1 中国证监会批准银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件
- 12.1.2 《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》
- 12.1.3 《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》

- 12.1.4 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司
2011 年 8 月 26 日