

# 益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年 半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

本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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务报表(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	37
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>37</b>

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
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.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	益民创新优势混合型证券投资基金
基金简称	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 11 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,716,927,187.48 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业，为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野，遵循从全球到国内的分析思路，从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面：技术创新，产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标，来综合构建基金组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

### 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		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李玲	李芳菲
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	jcb@ymfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95599
传真		010-63100588	010-63201816

注册地址	重庆市渝中区上清寺路 110 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100052	100031
法定代表人	翁振杰	项俊波

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	WWW.YMFUND.COM
基金半年度报告备置地点	北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	益民基金管理有限公司	北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

## § 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	219,943,936.65
本期利润	-323,731,445.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0665
本期加权平均净值利润率	-7.13%
本期基金份额净值增长率	-6.98%
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	-472,595,775.09
期末可供分配基金份额利润	-0.1002
期末基金资产净值	4,244,331,412.39
期末基金份额净值	0.8998
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	-8.63%

注：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。

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

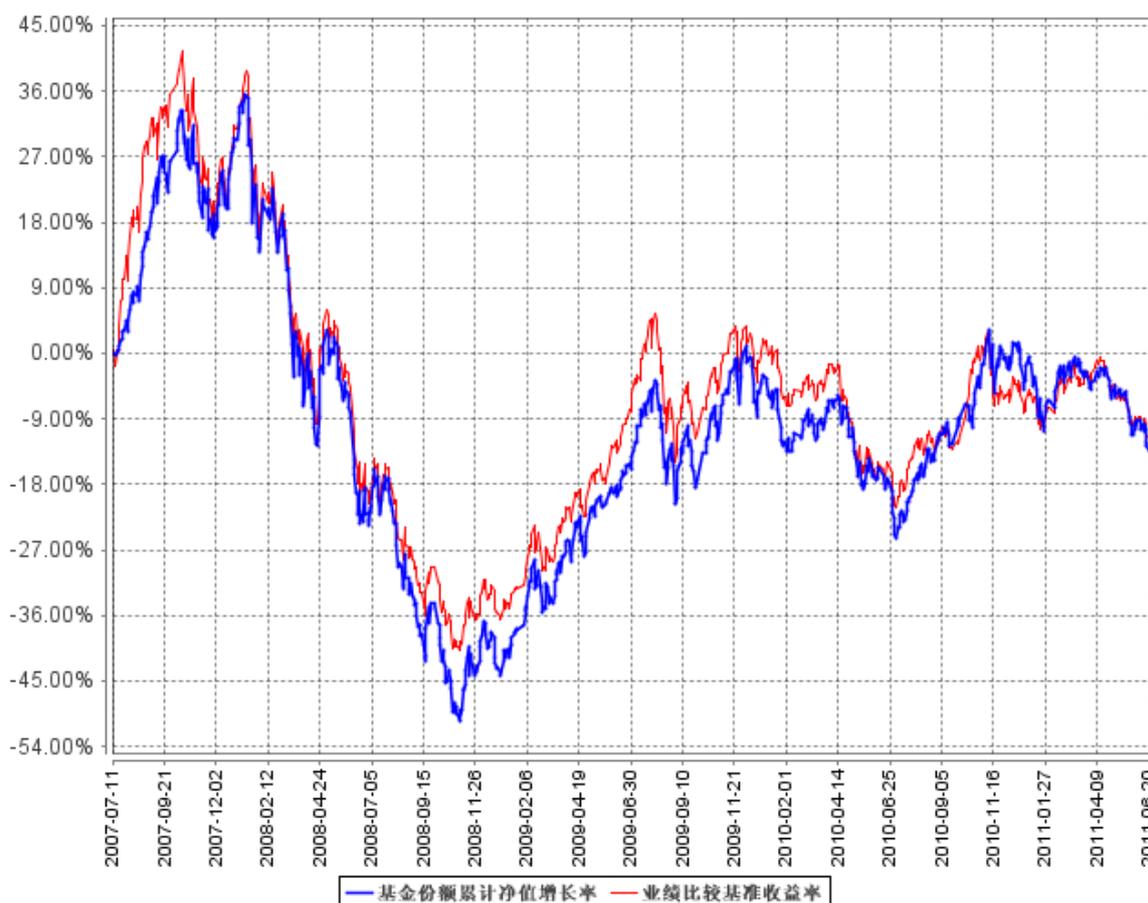
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.28%	1.08%	1.17%	0.89%	0.11%	0.19%
过去三个月	-3.86%	0.94%	-3.90%	0.82%	0.04%	0.12%
过去六个月	-6.98%	1.11%	-1.39%	0.92%	-5.59%	0.19%
过去一年	18.16%	1.23%	15.38%	1.05%	2.78%	0.18%
过去三年	16.87%	1.64%	13.80%	1.38%	3.07%	0.26%
自基金合同生效起至今	-8.63%	1.73%	-7.69%	1.56%	-0.94%	0.17%

注：自 2009 年 5 月 1 日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准，由原来的“沪深 300 指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%”变更为“沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%”。

### 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：按照本基金的基金合同约定，本基金自 2007 年 7 月 11 日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托有限公司（出资比例 49%）、中国新纪元有限公司（出资比例 31%）、中山证券有限责任公司（出资比例 20%）组成，注册资本为 1 亿元人民币，注册地：重庆，主要办公地点：北京。截至 2011 年 6 月末，公司管理的基金共有四只，均为开放式基金。其中，益民货币市场基金于 2006 年 7 月 17 日成立，首发规模超过 17 亿份；益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立，首发规模近 9 亿份；益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立，首发规模 73 亿份；益民多利债券型投资基金于 2008 年 5 月 21 日成立，首发规模超过 7 亿。

#### 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		
高广新	益民创新优势基金基金经理	2009年8月17日	-	13	硕士，1998年11月至2006年10月于国泰君安证券研究所从事行业研究，曾获新财富社会服务业和交通运输业最佳分析师，2006年10月进入益民基金管理公司曾任首席分析师及研究部总经理，投资决策委员会成员，2009年8月17日起任益民创新优势基金基金经理。

注：此处的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起规范的公平交易机制，对于场内交易，公司规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则

是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，不存在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的行为。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金的投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金运作未发现异常交易行为。

### 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

2011 年上半年，A 股市场经历了中东北非局势动荡、日本大地震及核危机等黑天鹅事件，外部欧美经济复苏缓慢、美元持续走弱、欧债危机反复，国内在 CPI 持续创新高的压力下，货币政策不断紧缩，实体经济资金紧张，市场资金价格高企。在此背景下，A 股走势呈现箱体震荡格局，市场估值水平持续下降。

本基金年初看好银行、地产、钢铁等板块的估值修复，基于短期和中长期的综合考虑，行业配置较均衡，组合中以大中盘股票为主。进入二季度，在市场下跌过程中，基于对后期市场谨慎乐观的判断，逐步加仓。报告期，由于对货币紧缩力度和通胀压力估计不足，加之市场对上述负面因素的过度预期，本基金相对中性的预判与市场走势有所背离。

#### 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 0.8998 元，本报告期份额净值增长率为-6.98%，同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，三季度国内通胀筑顶、经济下滑是大概率事件，紧缩政策压力有望缓解。根据申万研究所的测算，上证 2658 点隐含了 2011 年上市公司净利增长 5%、PE13 倍的假设，即该点位已

经对目前宏观不利因素做出了极端的反应。因此，我们认为市场底部已经确立。随着通胀回落、经济见底的完成，市场估值有望逐步修复到合理水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据相关规定，本基金管理人成立估值委员会，估值委员会是基金估值的最高决策机构，负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验，熟悉相关法规和估值方法。

**研究部行业研究员：**研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

**监察稽核部：**监察稽核部参与估值流程的人员，应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改；参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验，应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力，并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

**金融工程部金融工程人员：**金融工程人员负责估值相关数值的处理和计算，并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，具备基金绩效评估专业能力，并熟悉相关法规和估值方法。

**运作保障部基金会计：**基金会计在估值流程中的相关工作职责是参与基金组合停牌股票估值方法的确定，复核由估值委员会提供的估值价格，并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通，获悉的与基金估值的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度：

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

##### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

5、在符合有关基金分红条件的情况下，本基金收益分配每季度不超过三次，每年不超过十二次。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

## § 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

在托管益民创新优势混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》、《益民创新优势混合型证券投资基金托管协议》的约定，对益民创新优势混合型证券投资基金管理人—益民基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，益民基金管理有限公司在益民创新优势混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要

方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，益民基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2011 年 8 月 25 日

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	441,724,958.62	268,925,392.00
结算备付金		4,571,016.30	9,533,209.09
存出保证金		3,000,000.00	3,317,290.81
交易性金融资产	6.4.7.2	3,703,779,465.15	4,606,428,929.75
其中：股票投资		3,472,879,207.55	4,333,764,563.15
基金投资		-	-
债券投资		230,900,257.60	272,664,366.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,000.00	-
应收证券清算款		-	12,127,733.32
应收利息	6.4.7.5	2,676,081.59	3,542,442.19
应收股利		1,960,336.56	-
应收申购款		64,088.26	51,432.06
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,257,775,946.48	4,903,926,429.22
<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		-	-
应付赎回款		1,805,853.17	791,781.30
应付管理人报酬		5,145,446.34	6,367,368.67
应付托管费		857,574.39	1,061,228.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,908,439.15	4,362,656.36
应交税费		848,276.80	742,712.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,878,944.24	2,560,029.32
负债合计		13,444,534.09	15,885,776.59
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,716,927,187.48	5,053,264,940.60
未分配利润	6.4.7.10	-472,595,775.09	-165,224,287.97
所有者权益合计		4,244,331,412.39	4,888,040,652.63
负债和所有者权益总计		4,257,775,946.48	4,903,926,429.22

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8998 元，基金份额总额 4,716,927,187.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
<b>一、收入</b>		-276,467,321.32	-1,048,786,809.29
1. 利息收入		7,596,245.84	6,579,910.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,610,054.64	2,509,848.07
债券利息收入		3,963,192.90	3,483,977.93
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		2,022,998.30	586,084.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		259,601,962.36	77,857,690.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	235,137,695.87	63,553,775.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	51,152.73	1,399,780.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	24,413,113.76	12,904,134.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-543,675,382.50	-1,133,256,058.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,852.98	31,648.27
<b>减：二、费用</b>		47,264,124.53	60,468,149.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,817,903.75	37,372,742.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,636,317.30	6,228,790.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,671,023.56	16,727,977.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	138,879.92	138,639.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-323,731,445.85	-1,109,254,958.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-323,731,445.85	-1,109,254,958.86

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,053,264,940.60	-165,224,287.97	4,888,040,652.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-323,731,445.85	-323,731,445.85
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）	-336,337,753.12	16,359,958.73	-319,977,794.39
其中：1. 基金申购款	10,757,207.81	-874,735.96	9,882,471.85

2. 基金赎回款	-347,094,960.93	17,234,694.69	-329,860,266.24
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）	4,716,927,187.48	-472,595,775.09	4,244,331,412.39
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）	5,854,950,705.19	-258,582,620.32	5,596,368,084.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,109,254,958.86	-1,109,254,958.86
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）	-207,040,311.64	20,898,387.18	-186,141,924.46
其中：1. 基金申购款	21,125,424.83	-2,774,686.97	18,350,737.86
2. 基金赎回款	-228,165,736.47	23,673,074.15	-204,492,662.32
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）	5,647,910,393.55	-1,346,939,192.00	4,300,971,201.55

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：

雷学军  
基金管理公司负责人

吴晓明  
主管会计工作负责人

吴晓明  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

益民创新优势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）为经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]157号《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》及基金部函[2007]155号《关于益民创新优势混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》核准后进行募集，由益民基金管理有限公司负责基金发起并担任基金管理人，中国农业银行股份有限公司担任基金托管人。

本基金自2007年6月18日至2007年7月8日止向境内个人投资者和机构投资者及合格境外机构投资者公开募集，募集期结束后经信永中和会计师事务所有限责任公司以XYZH/2006A10059-1号验资报告验证，并报中国证监会备案，中国证监会于2007年7月11日以

基金部函[2007]184 号《关于益民创新优势混合型证券投资基金备案确认的函》书面确认。经验资及备案后，本基金合同于 2007 年 7 月 11 日生效。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金设立时募集的实收基金本金为人民币 7,231,963,653.33 元，募集期间产生的利息 6,159,321.48 元，实收基金本息共计 7,238,122,974.81 元，上述募集的实收基金根据每份基金份额的面值人民币 1.00 元折合为 7,238,122,974.81 份基金份额。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券监督管理委员会 [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〉》的公告和中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定，并基于中国证监会允许的以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合《企业会计准则》的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

#### 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]11 号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、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]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金享有的税收优惠及主要税项列示如下：

（一）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。

(二) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(三) 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。

(四) 基金买卖股票出让方按照 0.1% 缴纳印花税，受让方不缴纳印花税。

(五) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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	441,724,958.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	441,724,958.62

##### 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	3,495,631,708.84	3,472,879,207.55	-22,752,501.29	
债券	交易所市场	16,968,227.71	19,579,357.60	2,611,129.89
	银行间市场	212,993,101.41	211,320,900.00	-1,672,201.41
	合计	229,961,329.12	230,900,257.60	938,928.48
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,725,593,037.96	3,703,779,465.15	-21,813,572.81	

##### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	79,217.03
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	2,056.90
应收债券利息	2,555,868.78
应收买入返售证券利息	38,938.88
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,676,081.59

#### 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	1,900,397.53

银行间市场应付交易费用	8,041.62
合计	1,908,439.15

#### 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	2,750,000.00
应付赎回费	14.32
预提费用	128,929.92
合计	2,878,944.24

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,053,264,940.60	5,053,264,940.60
本期申购	10,757,207.81	10,757,207.81
本期赎回(以“-”号填列)	-347,094,960.93	-347,094,960.93
本期末	4,716,927,187.48	4,716,927,187.48

#### 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	-693,239,978.94	528,015,690.97	-165,224,287.97
本期利润	219,943,936.65	-543,675,382.50	-323,731,445.85
本期基金份额交易产生的变动数	38,645,792.46	-22,285,833.73	16,359,958.73
其中：基金申购款	-1,207,468.37	332,732.41	-874,735.96
基金赎回款	39,853,260.83	-22,618,566.14	17,234,694.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-434,650,249.83	-37,945,525.26	-472,595,775.09

#### 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	1,567,430.88
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	42,622.65
其他	1.11
合计	1,610,054.64

#### 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	2,697,955,975.47
减：卖出股票成本总额	2,462,818,279.60
买卖股票差价收入	235,137,695.87

#### 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	231,434,565.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	224,967,340.90
减：应收利息总额	6,416,072.32
债券投资收益	51,152.73

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 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	24,413,113.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	24,413,113.76

## 6.4.7.17 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	-543,675,382.50
——股票投资	-542,960,900.39
——债券投资	-714,482.11
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-543,675,382.50

## 6.4.7.18 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	9,852.98
合计	9,852.98

## 6.4.7.19 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	7,668,548.56
银行间市场交易费用	2,475.00
合计	7,671,023.56

## 6.4.7.20 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	29,752.78
信息披露费	99,177.14
其他	600.00
银行费用	350.00
债券账户维护费	9,000.00
合计	138,879.92

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在应披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期末不存在应披露的重大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

本报告期内无控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
益民基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中山证券有限责任公司	基金管理人的股东、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人
西南证券股份有限公司	基金管理人控股股东持股的公司、与本管理人的董事长为同一人、本基金的代销机构、本基金交易单元出租人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年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
西南证券股份 有限公司	350,109,846.25	7.26%	854,531,673.77	7.88%

中山证券有限 责任公司	-	-	282,440,121.21	2.61%
----------------	---	---	----------------	-------

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西南证券股份 有限公司	297,593.31	7.37%	97,054.42	5.11%
中山证券有限 责任公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西南证券股份 有限公司	726,351.83	8.01%	726,351.83	12.99%
中山证券有限 责任公司	240,074.90	2.65%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买/卖经手费、证券结算风险基金和证券交易所买/卖证管费等）。

关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准，与其签订的交易单元租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	33,817,903.75	37,372,742.21
其中：支付销售机构的客户维护费	2,945,324.83	6,698,752.23

注：(a) 计算标准

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

(b) 计算方式

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前三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的托管费	5,636,317.30	6,228,790.34

注：(a) 计算标准

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(b) 计算方式

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日（2007年7月11日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,426,308.25	8,426,308.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.15%

##### 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

截至本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

#### 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
中国农业银行股份有限公司	441,724,958.62	1,567,430.88	157,930,055.81	2,327,538.49

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

##### 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	重大事项	31.39	2011年7月4日	32.60	65,000	2,171,700.00	2,040,350.00	-
000759	中百集团	2011年4月14日	资产重组	10.98	-	-	6,069,639	66,719,930.77	66,644,636.22	-

##### 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市场债券正回购余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 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投资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。

投研部根据投资决策委员会有关资产流动性的原则性规定，制定具体的评估指标、评估方法，每月对基金投资组合的流动性进行评估，撰写评估报告，对基金组合的流动性指标提出维持及修正建议，分送基金经理、投资总监、监察稽核部门、投资决策委员会和风险控制委员会，然后各部门和相关人员做出反馈，以利于进一步完善流动性风险管理。

##### 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发行的证券，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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	88,996,900.00	68,769,100.00
A-1 以下	-	-
未评级	68,733,000.00	-
合计	157,729,900.00	68,769,100.00

注：未评级债券投资为本基金投资于国家债券、央行票据及国家政策金融债券等债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	47,818,957.60	48,484,266.60
AAA 以下	4,935,400.00	4,943,000.00
未评级	20,416,000.00	150,468,000.00
合计	73,170,357.60	203,895,266.60

注：未评级债券投资为本基金投资于国家债券、央行票据及国家政策金融债券等债券投资。

本基金的银行存款存放于本基金的托管行-中国农业银行。本基金认为与中国农业银行相关的信用风险不重大。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除披露的流通受限不能自由转入的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

本基金管理人通过对投资品种的流动性指标监控来评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动

性风险。本基金管理人通过基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产及负债主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产和卖出回购金融资产款。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产的比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本基金管理人通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	441,724,958.62	-	-	-	-	-	441,724,958.62
结算备付金	4,571,016.30	-	-	-	-	-	4,571,016.30
存出保证金	-	-	-	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
交易性金融资产	27,882,400.00	19,938,000.00	109,909,500.00	48,862,357.60	24,308,000.00	3,472,879,207.55	3,703,779,465.15
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,676,081.59	2,676,081.59
应收股利	-	-	-	-	-	1,960,336.56	1,960,336.56
应收申购款	-	-	-	-	-	64,088.26	64,088.26
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	574,178,374.92	19,938,000.00	109,909,500.00	48,862,357.60	24,308,000.00	3,480,579,713.96	4,257,775,946.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,805,853.17	1,805,853.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,145,446.34	5,145,446.34
应付托管费	-	-	-	-	-	857,574.39	857,574.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,908,439.15	1,908,439.15
应交税费	-	-	-	-	-	848,276.80	848,276.80
其他负债	-	-	-	-	-	2,878,944.24	2,878,944.24
负债总计	-	-	-	-	-	13,444,534.09	13,444,534.09
利率敏感度缺口	574,178,374.92	19,938,000.00	109,909,500.00	48,862,357.60	24,308,000.00	3,467,135,179.87	4,244,331,412.39
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	268,925,392.00	-	-	-	-	-	268,925,392.00
结算备付金	9,533,209.09	-	-	-	-	-	9,533,209.09
存出保证金	-	-	-	-	-	3,317,290.81	3,317,290.81
交易性金融资产	-	49,815,000.00	187,384,378.40	11,124,988.20	24,340,000.00	4,333,764,563.15	4,606,428,929.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,127,733.32	12,127,733.32
应收利息	-	-	-	-	-	3,542,442.19	3,542,442.19
应收申购款	-	-	-	-	-	51,432.06	51,432.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	278,458,601.09	49,815,000.00	187,384,378.40	11,124,988.20	24,340,000.00	4,352,803,461.53	4,903,926,429.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	791,781.30	791,781.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,367,368.67	6,367,368.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,061,228.14	1,061,228.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,362,656.36	4,362,656.36
应交税费	-	-	-	-	-	742,712.80	742,712.80
其他负债	-	-	-	-	-	2,560,029.32	2,560,029.32
负债总计	-	-	-	-	-	15,885,776.59	15,885,776.59
利率敏感度缺口	278,458,601.09	49,815,000.00	187,384,378.40	11,124,988.20	24,340,000.00	4,336,917,684.94	4,888,040,652.63

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）
	市场利率上升25个基点	-736,675.37	-
	市场利率下降25个基点	748,874.82	-

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金其他价格风险主要是市场价格风险，是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资相关，也有可能与投资组合整体相关。对本基金而言，其他价格风险源自于以交易性金融资产的公允价值受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。本基金通过优化投资组合、设置相关监控参数、跟踪与业绩基准的差异，及时调整资产配置比例、行业配置比例等方法来降低其他价格风险。

##### 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	3,472,879,207.55	81.82	4,333,764,563.15	88.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	230,900,257.60	5.44	272,664,366.60	5.58
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,703,779,465.15	87.26	4,606,428,929.75	94.24

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假 设	本基金的业绩比较基准中股票指数变动 5%。		
	根据期末时点股票资产相对于基准中股票指数的 Beta 系数计算的资产变动幅度。		
	Beta 系数是以市场过去 100 天的数据回归计算出来的，对于新股或者股票交易少于 100 天的股票，默认其波动与市场同步。		
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)
	比较基准的股票基准上升 5%	133,028,638.05	216,683,992.00
	比较基准的股票基准下降 5%	-133,028,638.05	-216,683,992.00

## § 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	3,472,879,207.55	81.57
	其中：股票	3,472,879,207.55	81.57
2	固定收益投资	230,900,257.60	5.42
	其中：债券	230,900,257.60	5.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	2.35
	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	446,295,974.92	10.48
6	其他各项资产	7,700,506.41	0.18
7	合计	4,257,775,946.48	100.00

### 7.2 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	168,290,152.69	3.97
B	采掘业	342,154,767.53	8.06
C	制造业	1,779,877,621.78	41.94
C0	食品、饮料	406,729,372.58	9.58
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	108,109,181.00	2.55
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	497,702,515.98	11.73
C7	机械、设备、仪表	342,307,261.60	8.07
C8	医药、生物制品	425,029,290.62	10.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	64,754,652.82	1.53
E	建筑业	3,981,212.82	0.09
F	交通运输、仓储业	99,522,494.16	2.34
G	信息技术业	78,356,336.20	1.85
H	批发和零售贸易	340,299,773.60	8.02
I	金融、保险业	353,825,095.37	8.34
J	房地产业	121,216,510.12	2.86
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	120,600,590.46	2.84
	合计	3,472,879,207.55	81.82

### 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

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	600298	安琪酵母	4,525,867	150,258,784.40	3.54
2	600416	湘电股份	11,466,280	138,856,650.80	3.27
3	002299	圣农发展	8,209,487	133,075,784.27	3.14
4	600518	康美药业	10,004,332	131,657,009.12	3.10
5	601699	潞安环能	3,903,541	128,075,180.21	3.02
6	000039	中集集团	5,702,622	124,773,369.36	2.94
7	002024	苏宁电器	9,513,841	121,872,303.21	2.87
8	600383	金地集团	18,910,532	121,216,510.12	2.86
9	600425	青松建化	5,816,743	121,104,589.26	2.85
10	600079	人福医药	5,473,500	120,745,410.00	2.84

11	600881	亚泰集团	14,477,862	120,600,590.46	2.84
12	601688	华泰证券	9,133,902	112,803,689.70	2.66
13	600887	伊利股份	6,516,996	108,507,983.40	2.56
14	000792	盐湖股份	1,832,359	108,109,181.00	2.55
15	601788	光大证券	7,556,599	103,903,236.25	2.45
16	601607	上海医药	6,125,543	102,909,122.40	2.42
17	600019	宝钢股份	16,945,006	102,178,386.18	2.41
18	600808	马钢股份	25,152,946	87,532,252.08	2.06
19	000983	西山煤电	3,342,648	80,892,081.60	1.91
20	000528	柳 工	3,546,520	80,257,747.60	1.89
21	000963	华东医药	3,195,831	77,562,818.37	1.83
22	000858	五 粮 液	2,154,139	76,945,845.08	1.81
23	000157	中联重科	4,914,955	75,592,007.90	1.78
24	600028	中国石化	9,045,121	74,441,345.83	1.75
25	600999	招商证券	3,917,651	72,006,425.38	1.70
26	600115	东方航空	13,718,819	71,337,858.80	1.68
27	000759	中百集团	6,069,639	66,644,636.22	1.57
28	600036	招商银行	5,000,902	65,111,744.04	1.53
29	000861	海印股份	2,583,753	45,939,128.34	1.08
30	000939	凯迪电力	3,310,841	42,511,198.44	1.00
31	000063	中兴通讯	1,299,955	36,762,727.40	0.87
32	002304	洋河股份	284,601	35,905,262.16	0.85
33	000713	丰乐种业	2,303,098	35,214,368.42	0.83
34	601898	中煤能源	3,498,777	34,987,770.00	0.82
35	600580	卧龙电气	4,135,717	33,995,593.74	0.80
36	002065	东华软件	1,417,026	33,583,516.20	0.79
37	000825	太钢不锈	6,019,752	31,001,722.80	0.73
38	600267	海正药业	790,772	29,527,426.48	0.70
39	002007	华兰生物	869,355	29,505,908.70	0.70
40	000829	天音控股	3,094,189	28,280,887.46	0.67
41	600029	南方航空	3,594,979	28,184,635.36	0.66
42	600176	中国玻纤	910,521	27,515,944.62	0.65
43	600546	山煤国际	761,731	23,758,389.89	0.56
44	600578	京能热电	2,290,778	22,243,454.38	0.52
45	002385	大北农	636,632	20,626,876.80	0.49
46	002220	天宝股份	811,009	14,484,620.74	0.34
47	600418	江淮汽车	1,224,596	13,605,261.56	0.32
48	600380	健康元	938,552	8,644,063.92	0.20
49	300101	国腾电子	273,382	8,010,092.60	0.19

50	601668	中国建筑	987,894	3,981,212.82	0.09
51	601992	金隅股份	232,316	3,596,251.68	0.08
52	600216	浙江医药	65,000	2,040,350.00	0.05

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600425	青松建化	143,336,327.75	2.93
2	600881	亚泰集团	118,261,803.84	2.42
3	600376	首开股份	111,558,447.79	2.28
4	600115	东方航空	108,656,477.48	2.22
5	601668	中国建筑	107,992,043.67	2.21
6	601166	兴业银行	106,869,129.05	2.19
7	000792	盐湖股份	106,068,565.35	2.17
8	000528	柳 工	99,608,089.86	2.04
9	601788	光大证券	96,378,861.71	1.97
10	600000	浦发银行	87,435,443.29	1.79
11	600999	招商证券	78,415,967.25	1.60
12	600028	中国石化	72,732,089.00	1.49
13	601318	中国平安	65,303,702.33	1.34
14	600808	马钢股份	63,199,289.11	1.29
15	600383	金地集团	50,596,540.79	1.04
16	002041	登海种业	48,375,088.09	0.99
17	600176	中国玻纤	47,698,145.28	0.98
18	000861	海印股份	47,401,389.76	0.97
19	600019	宝钢股份	44,943,601.12	0.92
20	600036	招商银行	39,532,554.74	0.81

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000939	凯迪电力	210,416,028.07	4.30
2	002167	东方锆业	176,976,242.03	3.62

3	601166	兴业银行	165,275,369.60	3.38
4	600000	浦发银行	150,736,886.75	3.08
5	600016	民生银行	132,436,914.80	2.71
6	601668	中国建筑	109,484,547.42	2.24
7	600376	首开股份	102,831,978.10	2.10
8	002041	登海种业	98,543,839.94	2.02
9	600418	江淮汽车	88,826,303.43	1.82
10	600348	国阳新能	87,978,583.44	1.80
11	002069	獐子岛	86,915,716.25	1.78
12	600383	金地集团	75,150,000.00	1.54
13	600380	健康元	74,997,833.73	1.53
14	600036	招商银行	73,584,499.67	1.51
15	601318	中国平安	68,274,844.33	1.40
16	601607	上海医药	63,712,606.16	1.30
17	600115	东方航空	62,280,451.44	1.27
18	000858	五粮液	60,867,539.17	1.25
19	000616	亿城股份	52,718,438.34	1.08
20	000060	中金岭南	52,379,614.10	1.07

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,144,893,824.39
卖出股票收入（成交）总额	2,697,955,975.47

#### 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	20,416,000.00	0.48
2	央行票据	48,795,000.00	1.15
3	金融债券	23,830,000.00	0.56
	其中：政策性金融债	19,938,000.00	0.47
4	企业债券	40,475,082.40	0.95
5	企业短期融资券	88,996,900.00	2.10
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,387,275.20	0.20
8	其他	-	-
9	合计	230,900,257.60	5.44

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

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	068019	06 京投债	300,000	29,283,000.00	0.69
2	1101030	11 央行票据 30	300,000	28,947,000.00	0.68
3	080003	08 国债 03	200,000	20,416,000.00	0.48
4	090307	09 进出 07	200,000	19,938,000.00	0.47
5	1101025	11 央行票据 25	200,000	19,848,000.00	0.47

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.9.2** 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

**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	3,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,960,336.56
4	应收利息	2,676,081.59
5	应收申购款	64,088.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,700,506.41

**7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	8,387,275.20	0.20

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
205,952	22,903.04	87,465,853.14	1.85%	4,629,461,334.34	98.15%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	499,478.80	0.01%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2007 年 7 月 11 日 ) 基金份额总额	7,238,122,974.81
本报告期期初基金份额总额	5,053,264,940.60
本报告期基金总申购份额	10,757,207.81
减:本报告期基金总赎回份额	347,094,960.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,716,927,187.48

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有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

益民基金管理有限公司第一届董事会第二十三次会议决定聘任雷学军先生担任益民基金管理有限公司总经理。雷学军先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]71号文核准。2011年1月17日，公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《益民基金管理有限公司关于总经理任职的公告》。

2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可[2011]116号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员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	
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中邮证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	580,266,740.58	12.03%	493,225.76	12.22%	-
国金证券	1	477,694,243.83	9.91%	406,040.01	10.06%	-
东兴证券	1	388,234,409.42	8.05%	329,997.02	8.17%	-
东方证券	1	357,781,203.46	7.42%	290,698.34	7.20%	-
西南证券	1	350,109,846.25	7.26%	297,593.31	7.37%	-
渤海证券	1	296,738,151.55	6.15%	241,101.32	5.97%	-
招商证券	1	296,388,163.42	6.15%	251,929.22	6.24%	-
华创证券	1	285,965,708.41	5.93%	232,348.18	5.75%	-
中信建投	1	257,000,105.03	5.33%	218,449.35	5.41%	-
申银万国	1	253,236,928.66	5.25%	215,252.67	5.33%	-
光大证券	1	194,742,017.19	4.04%	158,228.58	3.92%	-
中银国际	1	172,603,953.83	3.58%	146,713.88	3.63%	-
中金公司	2	262,912,076.46	5.45%	219,791.91	5.44%	-
银河证券	1	160,053,557.97	3.32%	136,045.86	3.37%	-
广发证券	1	126,914,375.61	2.63%	103,118.38	2.55%	-
建银证券	1	119,493,774.37	2.48%	97,089.23	2.40%	-
海通证券	1	99,303,886.51	2.06%	80,684.99	2.00%	-
国信证券	1	67,019,152.96	1.39%	56,966.34	1.41%	-
国联证券	1	56,193,114.68	1.17%	45,657.46	1.13%	-
安信证券	1	19,374,191.43	0.40%	16,467.39	0.41%	-

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

中山证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-220,000,000.00	18.80%	-	-
东兴证券	-	-	-390,000,000.00	33.33%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-230,000,000.00	19.66%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-230,000,000.00	19.66%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-100,000,000.00	8.55%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
建银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

(1) 基本情况：资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚；主要股东实力强大；具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(2) 公司治理：内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强的风险意识和风险测算能力；

(4) 服务能力：具备较强的服务意识，能主动为基金提供及时的市场信息及各种路演、公司

联合调研、券商会议的信息和参加机会；

(5) 综合业务能力：在投资银行业务上有较强的实力，能协助本公司基金参与股票、债券的发行；在新产品开发方面经验丰富，能帮助本公司拓展基金管理业务（如 QDII、集合理财产品等）；在证券创新品种开发方面处于行业前列（如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等）；

(6) 其他因素。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(1) 投资总监组织研究部、金融工程部、投资部经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件；

(2) 投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的席位租用安排以及相关评选材料；

(3) 投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的席位租用安排，审查通过后由总经理上报董事会，董事会如有相应授权的，由公司管理层依据授权内容办理；

(4) 券商名单及相应的席位租用安排确定后由交易部会同所选券商共同拟定席位租用协议，并交监察稽核部审核通过；

(5) 审核完成后交易部负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：深市新增渤海证券交易单元一个。

## 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	益民基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳发展银行股份有限公司基金网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2011 年 1 月 7 日
2	益民创新优势混合型证券投资基金 2010 年度第四季度报告	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 1 月 21 日
3	益民创新优势基金更新招募说明书摘要	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 2 月 25 日
4	益民创新优势基金更新招募说明书	公司网站	2011 年 2 月 25 日

5	益民创新优势混合型证券投资基金 2010 年度报告摘要	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 3 月 30 日
6	益民创新优势混合型证券投资基金 2010 年度报告	公司网站	2011 年 3 月 30 日
7	益民基金管理有限公司关于参加“华夏银行盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2011 年 4 月 6 日
8	益民创新优势混合型证券投资基金 2011 年度第 1 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 4 月 22 日
9	关于益民创新优势混合型证券投资基金开通中信证券股份有限公司基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 5 月 11 日
10	益民基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011 年 6 月 17 日
11	益民基金管理有限公司关于新增国联证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2011 年 6 月 22 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立益民创新优势混合型证券投资基金的文件；
- 2、益民创新优势混合型证券投资基金基金合同；
- 3、益民创新优势混合型证券投资基金托管协议；
- 4、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的公告。

## 11.2 存放地点

北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A。

## 11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人益民基金管理有限公司。

咨询电话：(86) 010-63105559 4006508808

公司传真：(86) 010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司

2011 年 8 月 27 日