

# 建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

## 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 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：二〇一二年三月三十日

## §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 2012 年 3 月 28 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告.....	14
6.1 管理层对财务报表的责任.....	14
6.2 注册会计师的责任.....	14
6.3 审计意见.....	15
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	52
8.7 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.....	52

8.8 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 .....	52
8.9 投资组合报告附注 .....	53
§9 基金份额持有人信息 .....	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	54
§10 开放式基金份额变动 .....	54
§11 重大事件揭示 .....	54
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
11.2 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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	57
§12 备查文件目录 .....	59
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §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	4,863,927,940.12 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%×沪深 300 指数收益率+5%×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	100032
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国上海市黄浦区湖滨路202号企业 天地2号楼普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2011年	2010年	2009年11月5日（基 金合同生效日）至2 009年12月31日
本期已实现收益	-172,497,443.73	-174,691,527.96	7,903,770.00
本期利润	-907,760,123.21	-410,178,304.68	58,375,100.64
加权平均基金份额本期 利润	-0.1978	-0.0804	0.0116
本期加权平均净值利润 率	-23.74%	-9.18%	1.16%
本期基金份额净值增长 率	-23.70%	-12.28%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-1,576,504,529.55	-594,376,133.72	6,597,337.55
期末可供分配基金份额 利润	-0.3241	-0.1140	0.0014
期末基金资产净值	3,287,423,410.57	4,619,029,777.58	4,656,217,003.64
期末基金份额净值	0.676	0.886	1.010
3.1.3 累计期末指标	2011年末	2010年末	2009年末

基金份额累计净值增长率	-32.40%	-11.40%	1.00%
-------------	---------	---------	-------

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
过去三个月	-8.77%	1.34%	-8.66%	1.34%	-0.11%	0.00%
过去六个月	-21.94%	1.29%	-21.88%	1.29%	-0.06%	0.00%
过去一年	-23.70%	1.23%	-23.83%	1.23%	0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	-32.40%	1.36%	-30.54%	1.39%	-1.86%	-0.03%

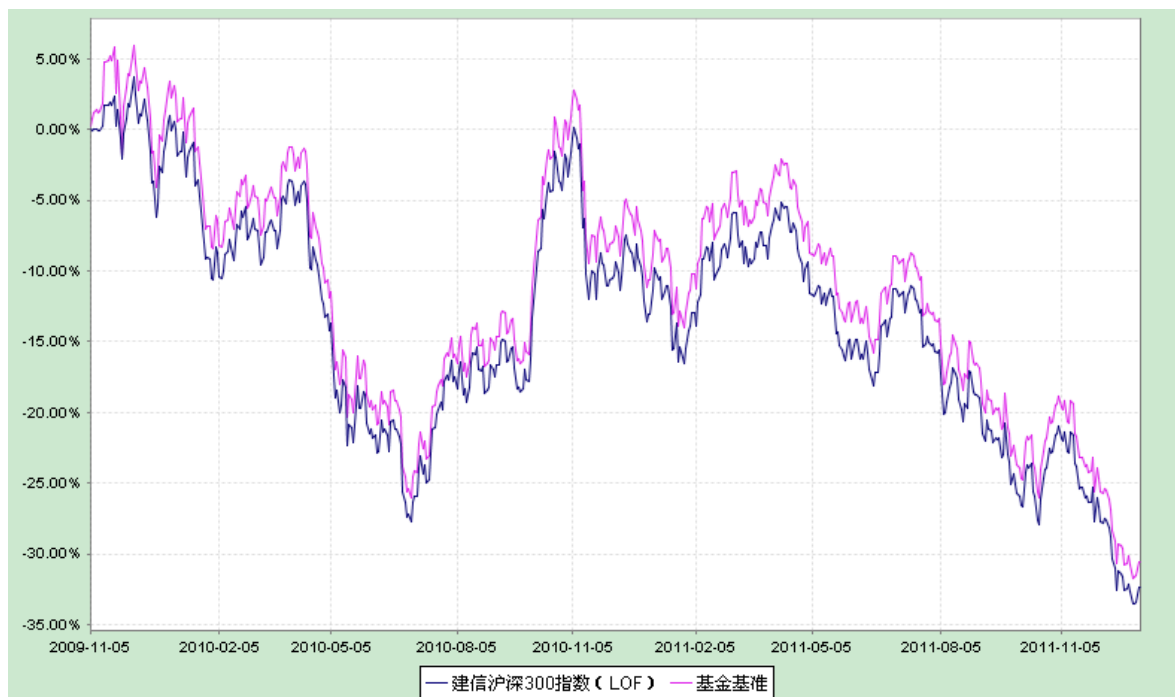
注：建信沪深 300 指数基金基金合同于 2009 年 11 月 5 日生效，截至报告日本基金成立未满三年。

#### 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 12 月 31 日)



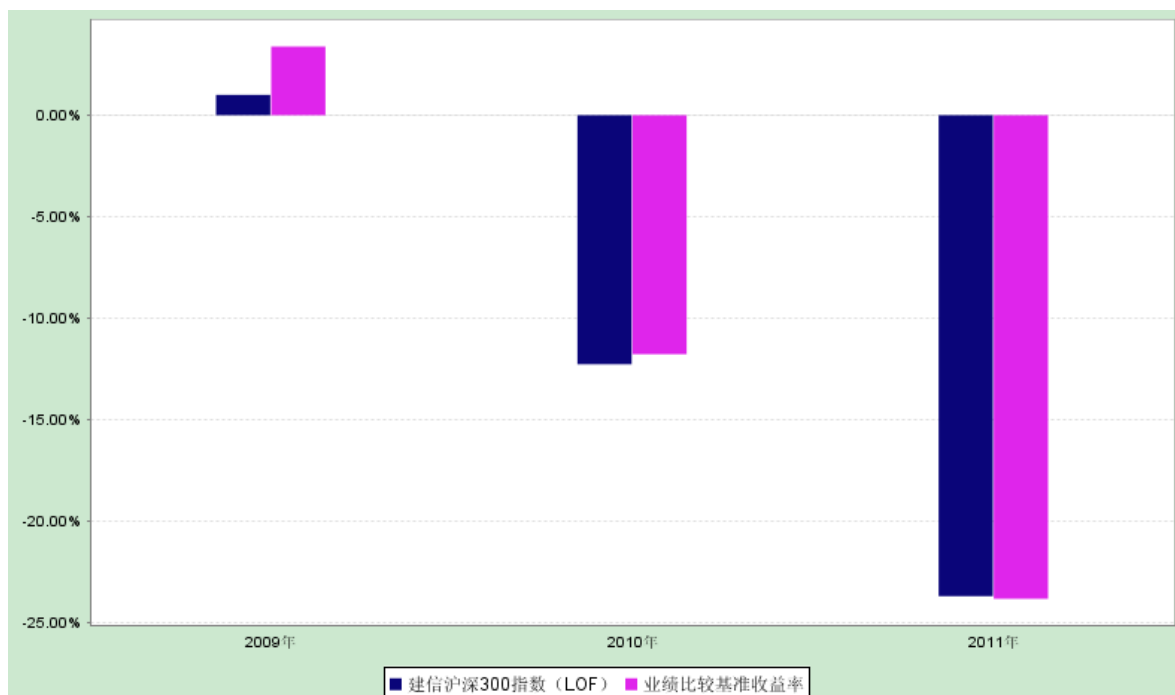
注：1、本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

### 3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图





注：本基金合同自 2009 年 11 月 5 日生效，截至报告日未满三年，2009 年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自 2009 年 11 月 5 日起生效，基金合同生效以来未发生过利润分配。

## §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 12 月 31 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、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金 (ETF) 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、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金 (ETF) 及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金 19 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 486.93 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	投资管理部执行总监, 本基金基金经理	2009-11-05	-	9	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、投资管理部副总监。2010 年 5 月 28 日起任上证社会责任 ETF 及联接基金基金经理; 2011 年 9 月 8 日起任深证基本面 60ETF 及联接基金基金经理。

## 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均控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内, 本基金跟踪误差最主要的来源是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。本基金管理人以量化分析研究为基础, 制定及执行了相应的替代策略, 并持续根据市场情况对替代方案进行优化和调整, 以尽可能降低跟踪误差及偏离度。

报告期内, 沪深 300 指数进行了两次成份股调整, 本基金管理人在量化分析基础上, 通过适当的组合调整策略, 对投资组合进行了相应调整, 尽可能地降低了其对基金跟踪误差及偏离度的影响。

在报告期内, 部分交易日的大额申购赎回、成份股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量克服这些不利影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年本基金净值增长率-23.70%, 波动率 1.23%, 业绩比较基准收益率-23.83%, 波动率 1.23%。

### 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, 2012 年的宏观经济形势仍将错综复杂。经过持续的政策调控, 通货膨胀压力有所缓解, 但经济增长的压力开始显现。股票市场在经历了深幅调整后, 风险在很大程度上得到了释放, 预计市场在 2012 年难以出现单边走势。

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, 克服部分成份股无法投资、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 年,本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点,坚持独立、客观、公正的原则,在督察长的指导下,公司监察稽核部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内,公司实施了不同形式的检查,对发现的潜在合规风险,及时与有关业务部门沟通并向管理层报告,采取相应措施防范风险。依照有关规定,定期向公司董事会、总经理和监管部门报送监察稽核报告,并根据不定期检查结果,形成专项审计报告,促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期,本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施:

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况,在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后,制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程,使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上,把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内,在公司自身经营和受托资产管理过程中,为化解和控制合规风险,事前制定了明确的合规风险控制指标,并相应地将其嵌入系统,实现系统自动管控,减少人工干预环节;对潜在合规风险事项,加强事前审查,以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作,以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督,业务部门作为合规性风险防范的第一道防线,需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前,皆要求业务部门进行风险自查,由监察稽核部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查,以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司 2011 年度监察稽核工作计划,实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目,重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节,尤其加强了对容易触发“三条底线”违规事件的防控检查,对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改,并对整改情况进行跟踪检查,促进

了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与外方股东信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的核心价值观，树立并坚持诚信、规范、专业、创新的经营理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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；根据需要进行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。

公司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）。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本报告期内本基金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，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 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

二〇一二年三月二十日

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20609 号

建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:

我们审计了后附的建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“建信沪深 300 基金”)的财务报表, 包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是建信沪深 300 基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括:

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表, 并使其实现公允反映;

(2)设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价

财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述建信沪深 300 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了建信沪深 300 基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞 张鸿  
中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼  
2012-03-21

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	84,422,970.98	148,878,218.14
结算备付金		1,396,205.32	2,771,079.64
存出保证金		1,082,443.77	779,415.77
交易性金融资产	7.4.7.2	3,205,958,184.95	4,473,933,602.69
其中：股票投资		3,109,138,184.95	4,373,573,602.69
基金投资		-	-
债券投资		96,820,000.00	100,360,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	17,491,000.96
应收利息	7.4.7.5	2,367,274.50	3,257,245.83
应收股利		-	-



应收申购款		159,516.58	1,493,600.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,295,386,596.10	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12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,550,438.38	19,569,330.10
应付赎回款		763,596.40	944,323.54
应付管理人报酬		2,121,500.47	2,983,144.57
应付托管费		424,300.09	596,628.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	641,895.14	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	7.4.7.8	461,455.05	175,620.55
负债合计		7,963,185.53	29,574,385.82
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	4,863,927,940.12	5,213,405,911.30
未分配利润	7.4.7.10	-1,576,504,529.55	-594,376,133.72
所有者权益合计		3,287,423,410.57	4,619,029,777.58
负债和所有者权益总计		3,295,386,596.10	4,648,604,163.40

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.676 元，基金份额总额 4,863,927,940.12 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年1	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年1
----	-----	------------------------	-----------------------------

		2月31日	2月31日
<b>一、收入</b>		-867,093,667.59	-362,869,629.07
1.利息收入		4,042,748.36	4,541,183.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	892,674.75	1,388,734.50
债券利息收入		3,150,073.61	3,152,448.89
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）		-137,645,730.28	-134,278,300.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-177,252,171.35	-177,155,713.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,551,557.69	-6,600.00
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	41,157,998.76	42,884,013.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-735,262,679.48	-235,486,776.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,771,993.81	2,354,264.40
<b>减：二、费用</b>		40,666,455.62	47,308,675.61
1.管理人报酬		28,753,036.47	33,477,020.91
2.托管费		5,750,607.33	6,695,404.16
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	5,659,181.51	6,594,388.08
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	503,630.31	541,862.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-907,760,123.21	-410,178,304.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-907,760,123.21	-410,178,304.68

## 7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	-	-907,760,123.21	-907,760,123.21
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)	-349,477,971.18	-74,368,272.62	-423,846,243.80
其中: 1.基金申购款	1,486,161,049.78	-263,444,611.98	1,222,716,437.80
2.基金赎回款	-1,835,639,020.96	189,076,339.36	-1,646,562,681.60
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)	4,863,927,940.12	-1,576,504,529.55	3,287,423,410.57
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	-	-410,178,304.68	-410,178,304.68
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)	602,838,551.28	-229,847,472.66	372,991,078.62
其中: 1.基金申购款	2,808,256,649.01	-428,615,412.06	2,379,641,236.95
2.基金赎回款	-2,205,418,097.73	198,767,939.40	-2,006,650,158.33
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)	5,213,405,911.30	-594,376,133.72	4,619,029,777.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。本基金的标的指数使用费由基金管理人建信基金管理有限责任公司承担,不计入本基金费用。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2012 年 3 月 21 日批准报出。

## 7.4.2 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 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券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。



## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策的变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计的变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	84,422,970.98	148,878,218.14
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	84,422,970.98	148,878,218.14

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,029,393,810.51	3,109,138,184.95	-920,255,625.56
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	96,842,500.00	96,820,000.00	-22,500.00
	合计	96,842,500.00	96,820,000.00	-22,500.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,126,236,310.51	3,205,958,184.95	-920,278,125.56
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,556,953,248.77	4,373,573,602.69	-183,379,646.08
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	101,995,800.00	100,360,000.00	-1,635,800.00
	合计	101,995,800.00	100,360,000.00	-1,635,800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,658,949,048.77	4,473,933,602.69	-185,015,446.08

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 1,613,300.00 元(2010 年度：公允价值变动损失为 1,629,200.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产或负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	20,408.51	32,946.06
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	691.13	1,066.89
应收债券利息	2,346,174.86	3,223,232.88
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	2,367,274.50	3,257,245.83

## 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	641,195.14	5,305,338.14
银行间市场应付交易费用	700.00	-
合计	641,895.14	5,305,338.14

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,054.09	2,093.59
预提费用	460,400.96	173,526.96
合计	461,455.05	175,620.55

## 7.4.7.9 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12月31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	1,486,161,049.78	1,486,161,049.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,835,639,020.96	-1,835,639,020.96

本期末	4,863,927,940.12	4,863,927,940.12
-----	------------------	------------------

注：截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 20,512,420.00 份(2010 年 12 月 31 日：23,496,220.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 4,843,415,520.12 份(2010 年 12 月 31 日：5,189,909,691.30 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。

#### 7.4.7.10 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	-172,497,443.73	-735,262,679.48	-907,760,123.21
本期基金份额交易产生的变动数	6,157,560.03	-80,525,832.65	-74,368,272.62
其中：基金申购款	-60,277,709.63	-203,166,902.35	-263,444,611.98
基金赎回款	66,435,269.66	122,641,069.70	189,076,339.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-333,315,842.46	-1,243,188,687.09	-1,576,504,529.55

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	829,439.84	1,280,122.07
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	21,983.47	51,871.27
其他	41,251.44	56,741.16
合计	892,674.75	1,388,734.50

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	2,012,268,467.66	2,092,564,497.34
减：卖出股票成本总额	2,189,520,639.01	2,269,720,211.07
买卖股票差价收入	-177,252,171.35	-177,155,713.73

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	307,764,394.90	200,000,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	301,744,600.00	199,326,600.00
减：应收利息总额	7,571,352.59	680,000.00
债券投资收益	-1,551,557.69	-6,600.00

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间无衍生金融工具收益。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	41,157,998.76	42,884,013.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	41,157,998.76	42,884,013.59

## 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
1.交易性金融资产	-735,262,679.48	-235,486,776.72
——股票投资	-736,875,979.48	-233,857,576.72
——债券投资	1,613,300.00	-1,629,200.00
——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	-735,262,679.48	-235,486,776.72

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	1,771,993.81	2,354,264.40
其他	-	-
合计	1,771,993.81	2,354,264.40

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。

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	5,657,681.51	6,593,588.08
银行间市场交易费用	1,500.00	800.00
合计	5,659,181.51	6,594,388.08

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	110,000.00	104,710.40
信息披露费	299,874.00	307,153.74
上市年费	60,000.00	90,000.00
银行划款手续费	15,756.31	20,498.32
债券托管帐户维护费	18,000.00	19,500.00
合计	503,630.31	541,862.46

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日本基金未存在或有事项。

## 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金代销机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团公司	基金管理人的原股东(2011年6月2日前)
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东(2011年6月2日起)

注：1. 根据建信基金管理有限责任公司 2010 年度第二次临时股东会决议以及中国证监会证监许可[2011]648 号文批准，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%的股权全部转让给中国华电集团资本控股有限公司。建信基金管理有限责任公司于 2011 年 6 月 2 日完成了工商登记变更手续。上述股权变更情况已于 2011 年 6 月 9 日在指定媒体和公司网站进行公告。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,753,036.47	33,477,020.91
其中：支付销售机构的客户维护费	6,615,479.58	9,750,985.75

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2011年1月1日至 2011年12月31日	2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,750,607.33	6,695,404.16

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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及上年末均未持有本基金。

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31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	84,422,970.98	829,439.84	148,878,218.14	1,280,122.07

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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



报告期末，本基金无因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### 7.4.12.2 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
000768	西飞国际	2011-12-28	筹划重大资产重组	7.26	2012-01-04	7.61	875,810	11,978,667.71	6,358,380.60	-
600132	重庆啤酒	2011-12-23	重要事项未公告	28.45	2012-01-10	25.61	206,331	7,677,709.45	5,870,116.95	-
合计								19,656,377.16	12,228,497.55	-

注：本基金截至 2011 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为进行被动化指数投资的股票型证券投资基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过严格的投资程序约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%，通过指数化投资实现与股票市场的同步增长，在控制风险的前提下力求获得标的指数

所代表的中国证券市场的平均收益率，

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管理工作中的风险控制政策，组织制定公司经营管理工作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工作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；监察稽核部承担其他风险的管理职责，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。

#### 7.4.13.2 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国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易

对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2010 年 12 月 31 日: 0.00%)。

#### 7.4.13.3 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风险管理委员会设定流动性比例要求,独立的风险管理部门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。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011年 12月31 日	1年以内	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产					
银行存款	84,422,970.98	-	-	-	84,422,970.98
结算备付金	1,396,205.32	-	-	-	1,396,205.32
存出保证金	-	-	-	1,082,443.77	1,082,443.77
交易性金融资产	96,820,000.00	-	-	3,109,138,184.95	3,205,958,184.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,367,274.50	2,367,274.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	4,970.18	-	-	154,546.40	159,516.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	182,644,146.48	-	-	3,112,742,449.62	3,295,386,596.10
负债					
短期借款	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,550,438.38	3,550,438.38
应付赎回款	-	-	-	763,596.40	763,596.40
应付管理人报酬	-	-	-	2,121,500.47	2,121,500.47
应付托管费	-	-	-	424,300.09	424,300.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	641,895.14	641,895.14
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	461,455.05	461,455.05
负债总计	-	-	-	7,963,185.53	7,963,185.53
利率敏感度缺口	182,644,146.48	-	-	3,104,779,264.09	3,287,423,410.57
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	148,878,218.14	-	-	-	148,878,218.14
结算备付金	2,771,079.64	-	-	-	2,771,079.64
存出保证金	-	-	-	779,415.77	779,415.77
交易性金融资产	100,360,000.00	-	-	4,373,573,602.69	4,473,933,602.69
应收证券清算款	-	-	-	17,491,000.96	17,491,000.96
应收利息	-	-	-	3,257,245.83	3,257,245.83
应收申购	-	-	-	1,493,600.37	1,493,600.37

款					
资产总计	252,009,297.78	-	-	4,396,594,865.62	4,648,604,163.40
负债					
应付证券清算款	19,569,330.10	-	-	-	19,569,330.10
应付赎回款	-	-	-	944,323.54	944,323.54
应付管理人报酬	-	-	-	2,983,144.57	2,983,144.57
应付托管费	-	-	-	596,628.92	596,628.92
应付交易费用	-	-	-	5,305,338.14	5,305,338.14
其他负债	-	-	-	175,620.55	175,620.55
负债总计	19,569,330.10	-	-	10,005,055.72	29,574,385.82
利率敏感度缺口	232,439,967.68	-	-	4,386,589,809.90	4,619,029,777.58

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 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 2.95%(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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响

时, 基金管理人会对投资组合进行适当调整, 以便实现对跟踪误差的有效控制。

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, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	3,109,138,184.95	94.58	4,373,573,602.69	94.69
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,109,138,184.95	94.58	4,373,573,602.69	94.69

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准 (附注 7.4.1) 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 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准 (附注 7.4.1) 上升 5%	增加约 162,402,267.80	增加约 228,816,385.40
2. 业绩比较基准 (附注 7.4.1) 下降 5%	减少约 162,402,267.80	减少约 228,816,385.40	

#### 7.4.14 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

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 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 3,096,909,687.40 元，属于第二层级的余额为 109,048,497.55 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 4,319,054,289.04 元，第二层级 154,879,313.65 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级 0 元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动 0 元(2010 年度：无)，涉及河南双汇投资发展股份有限公司(“双汇发展”)发行的股票。

(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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	3,109,138,184.95	94.35
	其中：股票	3,109,138,184.95	94.35



2	固定收益投资	96,820,000.00	2.94
	其中：债券	96,820,000.00	2.94
	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	85,819,176.30	2.60
6	其他各项资产	3,609,234.85	0.11
7	合计	3,295,386,596.10	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	17,436,587.78	0.53
B	采掘业	336,107,486.05	10.22
C	制造业	1,034,985,609.69	31.48
C0	食品、饮料	227,787,653.13	6.93
C1	纺织、服装、皮毛	8,637,113.38	0.26
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	55,149,776.14	1.68
C5	电子	31,899,522.31	0.97
C6	金属、非金属	230,063,865.37	7.00
C7	机械、设备、仪表	347,252,958.03	10.56
C8	医药、生物制品	134,194,721.33	4.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	67,582,032.11	2.06
E	建筑业	81,187,764.72	2.47
F	交通运输、仓储业	95,941,049.78	2.92
G	信息技术业	109,859,327.93	3.34
H	批发和零售贸易	77,938,942.27	2.37
I	金融、保险业	960,876,032.69	29.23
J	房地产业	146,362,867.84	4.45
K	社会服务业	26,287,557.28	0.80

L	传播与文化产业	6,860,800.44	0.21
M	综合类	52,201,239.77	1.59
	合计	3,013,627,298.35	91.67

注：以上行业分类以 2011 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 积极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	3,722,715.58	0.11
B	采掘业	3,276,091.47	0.10
C	制造业	59,995,037.33	1.82
C0	食品、饮料	3,105,464.96	0.09
C1	纺织、服装、皮毛	2,336,545.62	0.07
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,453,643.35	0.20
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	19,984,566.99	0.61
C7	机械、设备、仪表	13,066,716.76	0.40
C8	医药、生物制品	13,807,620.05	0.42
C99	其他制造业	1,240,479.60	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,049,948.31	0.31
E	建筑业	2,557,542.78	0.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,128,766.30	0.13
H	批发和零售贸易	4,838,698.49	0.15
I	金融、保险业	2,091,401.34	0.06
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,850,685.00	0.15
	合计	95,510,886.60	2.91

注：以上行业分类以 2011 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.3 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

## 8.3.1 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	9,458,808	112,276,050.96	3.42
2	600016	民生银行	17,466,349	102,876,795.61	3.13
3	601318	中国平安	2,309,287	79,531,844.28	2.42
4	601328	交通银行	16,268,764	72,884,062.72	2.22
5	601166	兴业银行	5,496,405	68,814,990.60	2.09
6	600000	浦发银行	7,714,023	65,492,055.27	1.99
7	601288	农业银行	22,688,392	59,443,587.04	1.81
8	601088	中国神华	2,273,254	57,581,523.82	1.75
9	600519	贵州茅台	286,222	55,326,712.60	1.68
10	000002	万科A	6,672,012	49,839,929.64	1.52
11	600030	中信证券	4,746,795	46,091,379.45	1.40
12	000858	五粮液	1,308,165	42,907,812.00	1.31
13	600837	海通证券	5,670,937	42,021,643.17	1.28
14	601601	中国太保	2,166,521	41,618,868.41	1.27
15	601988	中国银行	12,502,562	36,507,481.04	1.11
16	600050	中国联通	5,843,811	30,621,569.64	0.93
17	601006	大秦铁路	4,098,711	30,576,384.06	0.93
18	601668	中国建筑	10,338,588	30,085,291.08	0.92
19	601169	北京银行	3,004,596	27,882,650.88	0.85
20	000001	深发展A	1,765,607	27,525,813.13	0.84
21	600015	华夏银行	2,360,489	26,508,291.47	0.81
22	600031	三一重工	2,093,552	26,253,142.08	0.80
23	600048	保利地产	2,459,893	24,598,930.00	0.75
24	002024	苏宁电器	2,893,239	24,418,937.16	0.74
25	601818	光大银行	8,360,735	24,078,916.80	0.73
26	002304	洋河股份	186,095	24,000,672.15	0.73
27	601857	中国石油	2,446,786	23,831,695.64	0.72
28	000651	格力电器	1,359,540	23,506,446.60	0.72
29	000157	中联重科	3,027,851	23,284,174.19	0.71
30	000063	中兴通讯	1,355,897	22,914,659.30	0.70
31	600887	伊利股份	1,101,850	22,510,795.50	0.68

32	600900	长江电力	3,431,806	21,826,286.16	0.66
33	600585	海螺水泥	1,378,376	21,571,584.40	0.66
34	601899	紫金矿业	5,446,301	20,804,869.82	0.63
35	600028	中国石化	2,869,992	20,606,542.56	0.63
36	600111	包钢稀土	500,811	18,845,517.93	0.57
37	601628	中国人寿	1,033,861	18,237,308.04	0.55
38	600104	上海汽车	1,274,048	18,015,038.72	0.55
39	000568	泸州老窖	480,483	17,922,015.90	0.55
40	600019	宝钢股份	3,620,998	17,561,840.30	0.53
41	000527	美的电器	1,399,576	17,130,810.24	0.52
42	600256	广汇股份	805,115	16,569,266.70	0.50
43	000338	潍柴动力	521,599	16,430,368.50	0.50
44	600999	招商证券	1,606,307	16,352,205.26	0.50
45	000983	西山煤电	1,085,966	15,855,103.60	0.48
46	601989	中国重工	3,032,868	15,497,955.48	0.47
47	000423	东阿阿胶	360,622	15,488,714.90	0.47
48	600383	金地集团	3,081,939	15,255,598.05	0.46
49	600795	国电电力	5,305,271	14,801,706.09	0.45
50	000895	双汇发展	208,838	14,608,218.10	0.44
51	000792	盐湖股份	438,497	14,018,749.09	0.43
52	600089	特变电工	1,816,532	13,950,965.76	0.42
53	600547	山东黄金	490,419	13,922,995.41	0.42
54	000069	华侨城 A	1,927,617	13,763,185.38	0.42
55	600406	国电南瑞	434,370	13,552,344.00	0.41
56	601699	潞安环能	634,399	13,423,882.84	0.41
57	601009	南京银行	1,432,414	13,292,801.92	0.40
58	000776	广发证券	611,972	12,851,412.00	0.39
59	601600	中国铝业	1,980,982	12,717,904.44	0.39
60	600348	阳泉煤业	833,687	12,655,368.66	0.38
61	600362	江西铜业	572,137	12,546,964.41	0.38
62	601168	西部矿业	1,313,966	12,311,861.42	0.37
63	600518	康美药业	1,060,809	11,902,276.98	0.36
64	600489	中金黄金	676,197	11,840,209.47	0.36
65	601766	中国南车	2,706,229	11,717,971.57	0.36
66	600739	辽宁成大	940,612	11,560,121.48	0.35

67	600276	恒瑞医药	387,405	11,405,203.20	0.35
68	601898	中煤能源	1,261,584	11,366,871.84	0.35
69	600068	葛洲坝	1,442,217	11,105,070.90	0.34
70	600875	东方电气	458,720	10,601,019.20	0.32
71	000709	河北钢铁	3,659,379	10,465,823.94	0.32
72	000538	云南白药	191,407	10,144,571.00	0.31
73	000402	金融街	1,669,106	10,098,091.30	0.31
74	600690	青岛海尔	1,110,418	9,916,032.74	0.30
75	601299	中国北车	2,288,275	9,725,168.75	0.30
76	600100	同方股份	1,095,985	9,644,668.00	0.29
77	600309	烟台万华	745,183	9,612,860.70	0.29
78	601788	光大证券	942,328	9,611,745.60	0.29
79	600123	兰花科创	236,217	9,184,116.96	0.28
80	600188	兖州煤业	408,030	9,135,791.70	0.28
81	601688	华泰证券	1,157,922	9,054,950.04	0.28
82	600642	申能股份	1,955,554	8,975,992.86	0.27
83	601390	中国中铁	3,534,249	8,906,307.48	0.27
84	601618	中国中冶	3,357,767	8,864,504.88	0.27
85	600660	福耀玻璃	1,104,352	8,856,903.04	0.27
86	600177	雅戈尔	920,801	8,637,113.38	0.26
87	601666	平煤股份	813,704	8,600,851.28	0.26
88	000100	TCL 集团	4,673,697	8,599,602.48	0.26
89	000024	招商地产	474,872	8,547,696.00	0.26
90	000630	铜陵有色	489,914	8,235,454.34	0.25
91	002202	金风科技	1,058,776	8,205,514.00	0.25
92	000012	南玻 A	905,146	8,200,622.76	0.25
93	000009	中国宝安	751,789	8,194,500.10	0.25
94	000060	中金岭南	995,302	8,191,335.46	0.25
95	000783	长江证券	1,143,969	8,179,378.35	0.25
96	600009	上海机场	664,068	8,128,192.32	0.25
97	000425	徐工机械	568,694	8,086,828.68	0.25
98	000937	冀中能源	478,240	8,063,126.40	0.25
99	600005	武钢股份	2,782,812	8,042,326.68	0.24
100	601186	中国铁建	2,121,736	8,041,379.44	0.24
101	600600	青岛啤酒	239,826	8,029,374.48	0.24

102	000878	云南铜业	488,119	7,858,715.90	0.24
103	000869	张裕 A	72,126	7,782,395.40	0.24
104	601117	中国化学	1,359,923	7,751,561.10	0.24
105	000623	吉林敖东	379,374	7,735,435.86	0.24
106	601998	中信银行	1,897,059	7,664,118.36	0.23
107	000039	中集集团	594,360	7,637,526.00	0.23
108	601958	金钼股份	667,171	7,592,405.98	0.23
109	600271	航天信息	381,867	7,583,878.62	0.23
110	600150	中国船舶	292,263	7,569,611.70	0.23
111	600535	天士力	179,016	7,507,931.04	0.23
112	600143	金发科技	577,514	7,467,256.02	0.23
113	601919	中国远洋	1,578,842	7,388,980.56	0.22
114	600583	海油工程	1,340,378	7,372,079.00	0.22
115	600415	小商品城	937,920	7,353,292.80	0.22
116	601111	中国国航	1,148,173	7,313,862.01	0.22
117	600010	包钢股份	1,770,971	7,296,400.52	0.22
118	002142	宁波银行	795,057	7,282,722.12	0.22
119	002422	科伦药业	165,347	7,176,059.80	0.22
120	000401	冀东水泥	417,945	6,967,143.15	0.21
121	601727	上海电气	1,357,900	6,925,290.00	0.21
122	600029	南方航空	1,452,086	6,882,887.64	0.21
123	601333	广深铁路	1,947,872	6,856,509.44	0.21
124	600694	大商股份	202,443	6,737,303.04	0.20
125	600196	复星医药	787,538	6,725,574.52	0.20
126	600655	豫园商城	792,527	6,641,376.26	0.20
127	000422	湖北宜化	373,829	6,598,081.85	0.20
128	600741	华域汽车	712,178	6,594,768.28	0.20
129	600058	五矿发展	295,522	6,474,887.02	0.20
130	000933	神火股份	694,754	6,419,526.96	0.20
131	000768	西飞国际	875,810	6,358,380.60	0.19
132	600085	同仁堂	448,718	6,295,513.54	0.19
133	002073	软控股份	409,334	6,193,223.42	0.19
134	600881	亚泰集团	1,305,924	6,190,079.76	0.19
135	600115	东方航空	1,609,143	6,114,743.40	0.19
136	000876	新希望	359,302	6,018,308.50	0.18

137	601717	郑煤机	241,162	5,997,698.94	0.18
138	600066	宇通客车	250,831	5,934,661.46	0.18
139	002415	海康威视	137,762	5,923,766.00	0.18
140	600166	福田汽车	1,017,817	5,913,516.77	0.18
141	601808	中海油服	408,095	5,913,296.55	0.18
142	600153	建发股份	925,408	5,904,103.04	0.18
143	600497	驰宏锌锗	451,485	5,900,908.95	0.18
144	000969	安泰科技	355,187	5,881,896.72	0.18
145	601607	上海医药	530,168	5,874,261.44	0.18
146	600132	重庆啤酒	206,331	5,870,116.95	0.18
147	000825	太钢不锈	1,570,431	5,857,707.63	0.18
148	600125	铁龙物流	629,872	5,845,212.16	0.18
149	600832	东方明珠	1,098,074	5,797,830.72	0.18
150	000898	鞍钢股份	1,271,442	5,785,061.10	0.18
151	000728	国元证券	676,780	5,752,630.00	0.17
152	600267	海正药业	180,863	5,746,017.51	0.17
153	601106	中国一重	1,802,499	5,731,946.82	0.17
154	600320	振华重工	1,217,298	5,721,300.60	0.17
155	600809	山西汾酒	89,517	5,652,103.38	0.17
156	000729	燕京啤酒	417,082	5,626,436.18	0.17
157	601001	大同煤业	461,432	5,611,013.12	0.17
158	600549	厦门钨业	188,019	5,578,523.73	0.17
159	000960	锡业股份	312,405	5,563,933.05	0.17
160	600369	西南证券	640,307	5,525,849.41	0.17
161	000758	中色股份	317,046	5,462,702.58	0.17
162	000528	柳工	468,075	5,462,435.25	0.17
163	600839	四川长虹	2,545,358	5,447,066.12	0.17
164	600804	鹏博士	922,556	5,360,050.36	0.16
165	002155	辰州矿业	264,098	5,300,446.86	0.16
166	600550	天威保变	473,160	5,289,928.80	0.16
167	600582	天地科技	278,894	5,159,539.00	0.16
168	600859	王府井	159,479	5,120,870.69	0.16
169	600893	航空动力	375,489	5,102,895.51	0.16
170	600219	南山铝业	799,858	5,063,101.14	0.15
171	600588	用友软件	281,177	5,061,186.00	0.15

172	600811	东方集团	919,063	5,045,655.87	0.15
173	002007	华兰生物	198,572	4,966,285.72	0.15
174	600779	水井坊	235,708	4,964,010.48	0.15
175	000800	一汽轿车	560,869	4,963,690.65	0.15
176	600118	中国卫星	242,984	4,956,873.60	0.15
177	600376	首开股份	515,095	4,939,761.05	0.15
178	600316	洪都航空	296,479	4,936,375.35	0.15
179	002001	新 和 成	250,176	4,918,460.16	0.15
180	000625	长安汽车	1,296,080	4,899,182.40	0.15
181	600664	哈药股份	667,711	4,894,321.63	0.15
182	002106	莱宝高科	289,627	4,854,148.52	0.15
183	002069	獐 子 岛	196,024	4,814,349.44	0.15
184	601101	昊华能源	275,696	4,780,568.64	0.15
185	601888	中国国旅	181,960	4,772,810.80	0.15
186	600649	城投控股	791,969	4,767,653.38	0.15
187	002092	中泰化学	636,461	4,767,092.89	0.15
188	600997	开滦股份	425,482	4,739,869.48	0.14
189	600331	宏达股份	568,979	4,733,905.28	0.14
190	000061	农 产 品	423,686	4,724,098.90	0.14
191	600395	盘江股份	228,146	4,711,214.90	0.14
192	600108	亚盛集团	957,762	4,693,033.80	0.14
193	000999	华润三九	269,879	4,668,906.70	0.14
194	002385	大北农	138,028	4,485,910.00	0.14
195	601179	中国西电	1,201,207	4,444,465.90	0.14
196	600208	新湖中宝	1,284,201	4,391,967.42	0.13
197	600703	三安光电	398,109	4,351,331.37	0.13
198	000839	中信国安	648,408	4,337,849.52	0.13
199	601558	华锐风电	276,994	4,332,186.16	0.13
200	000562	宏源证券	402,848	4,318,530.56	0.13
201	601918	国投新集	382,608	4,258,427.04	0.13
202	600598	北大荒	490,099	4,244,257.34	0.13
203	000778	新兴铸管	660,592	4,221,182.88	0.13
204	601018	宁波港	1,764,453	4,217,042.67	0.13
205	600635	大众公用	906,967	4,162,978.53	0.13
206	600718	东软集团	507,664	4,132,384.96	0.13



207	600808	马钢股份	1,654,963	4,104,308.24	0.12
208	600352	浙江龙盛	712,631	4,076,249.32	0.12
209	601866	中海集运	1,640,140	3,985,540.20	0.12
210	601158	重庆水务	661,670	3,976,636.70	0.12
211	600970	中材国际	251,182	3,958,628.32	0.12
212	600008	首创股份	758,164	3,942,452.80	0.12
213	601369	陕鼓动力	338,822	3,882,900.12	0.12
214	600516	方大炭素	440,796	3,861,372.96	0.12
215	600169	太原重工	668,274	3,802,479.06	0.12
216	600266	北京城建	306,436	3,796,742.04	0.12
217	000680	山推股份	418,597	3,759,001.06	0.11
218	600508	上海能源	199,251	3,731,971.23	0.11
219	600418	江淮汽车	621,774	3,705,773.04	0.11
220	600216	浙江医药	186,120	3,701,926.80	0.11
221	600062	双鹤药业	236,422	3,688,183.20	0.11
222	601118	海南橡胶	541,904	3,684,947.20	0.11
223	002128	露天煤业	274,322	3,675,914.80	0.11
224	600812	华北制药	567,149	3,675,125.52	0.11
225	600879	航天电子	447,201	3,671,520.21	0.11
226	600221	海南航空	814,840	3,650,483.20	0.11
227	600895	张江高科	533,709	3,623,884.11	0.11
228	002310	东方园林	41,422	3,593,358.50	0.11
229	600037	歌华有线	438,508	3,503,678.92	0.11
230	600432	吉恩镍业	279,437	3,445,458.21	0.10
231	600863	内蒙华电	409,661	3,400,186.30	0.10
232	002146	荣盛发展	385,357	3,391,141.60	0.10
233	601098	中南传媒	371,363	3,357,121.52	0.10
234	000027	深圳能源	546,497	3,333,631.70	0.10
235	600546	山煤国际	136,639	3,313,495.75	0.10
236	601933	永辉超市	105,854	3,191,498.10	0.10
237	600500	中化国际	495,422	3,165,746.58	0.10
238	000059	辽通化工	413,719	3,144,264.40	0.10
239	000807	云铝股份	636,516	3,131,658.72	0.10
240	000559	万向钱潮	549,070	3,107,736.20	0.09
241	600595	中孚实业	522,056	3,017,483.68	0.09

242	000718	苏宁环球	563,300	2,951,692.00	0.09
243	600674	川投能源	257,203	2,880,673.60	0.09
244	000780	平庄能源	279,640	2,880,292.00	0.09
245	600161	天坛生物	177,640	2,856,451.20	0.09
246	600096	云天化	191,233	2,845,547.04	0.09
247	601377	兴业证券	303,266	2,820,373.80	0.09
248	600971	恒源煤电	206,773	2,735,606.79	0.08
249	601718	际华集团	797,519	2,727,514.98	0.08
250	002399	海普瑞	110,306	2,724,558.20	0.08
251	600183	生益科技	377,231	2,723,607.82	0.08
252	600456	宝钛股份	148,278	2,701,625.16	0.08
253	002405	四维图新	132,321	2,657,005.68	0.08
254	002122	天马股份	409,409	2,652,970.32	0.08
255	002493	荣盛石化	153,287	2,619,674.83	0.08
256	600026	中海发展	435,990	2,581,060.80	0.08
257	000968	煤气化	177,048	2,522,934.00	0.08
258	600528	中铁二局	502,869	2,479,144.17	0.08
259	600428	中远航运	582,561	2,400,151.32	0.07
260	600151	航天机电	329,965	2,375,748.00	0.07
261	000021	长城开发	454,649	2,332,349.37	0.07
262	000686	东北证券	176,256	2,185,574.40	0.07
263	002500	山西证券	330,808	2,140,327.76	0.07
264	600170	上海建工	239,103	2,120,843.61	0.06
265	600307	酒钢宏兴	563,985	2,120,583.60	0.06
266	600380	健康元	355,151	2,098,942.41	0.06
267	600737	中粮屯河	346,551	2,082,771.51	0.06
268	600109	国金证券	206,822	2,051,674.24	0.06
269	000961	中南建设	241,477	2,033,236.34	0.06
270	002244	滨江集团	279,556	1,982,052.04	0.06
271	600481	双良节能	223,339	1,648,241.82	0.05
272	601268	二重重装	232,963	1,644,718.78	0.05
273	002498	汉缆股份	97,183	1,593,801.20	0.05
274	601519	大智慧	95,805	1,042,358.40	0.03

## 8.3.2 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	000629	攀钢钒钛	1,973,384	12,392,851.52	0.38
2	000581	威孚高科	249,364	8,949,673.96	0.27
3	601991	大唐发电	1,377,497	7,107,884.52	0.22
4	600252	中恒集团	601,900	6,392,178.00	0.19
5	002038	双鹭药业	157,359	5,169,243.15	0.16
6	600160	巨化股份	244,090	4,894,004.50	0.15
7	600770	综艺股份	304,500	4,850,685.00	0.15
8	600498	烽火通信	152,353	4,128,766.30	0.13
9	600372	中航电子	169,845	4,117,042.80	0.13
10	002299	圣农发展	251,026	3,722,715.58	0.11
11	601992	金隅股份	429,283	3,610,270.03	0.11
12	600259	广晟有色	85,919	3,276,091.47	0.10
13	600873	梅花集团	373,253	3,105,464.96	0.09
14	600098	广州控股	425,769	2,942,063.79	0.09
15	600783	鲁信创投	153,858	2,643,280.44	0.08
16	002344	海宁皮城	115,613	2,616,322.19	0.08
17	002431	棕榈园林	105,771	2,557,542.78	0.08
18	601233	桐昆股份	199,194	2,336,545.62	0.07
19	002603	以岭药业	58,510	2,246,198.90	0.07
20	601258	庞大集团	361,362	2,222,376.30	0.07
21	601099	太平洋	310,758	2,091,401.34	0.06
22	601216	内蒙君正	88,165	1,559,638.85	0.05
23	002378	章源钨业	58,950	1,338,165.00	0.04
24	002594	比亚迪	54,407	1,240,479.60	0.04

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600036	招商银行	67,029,950.83	1.45
2	601288	农业银行	59,104,312.64	1.28
3	601988	中国银行	51,477,154.67	1.11
4	600016	民生银行	32,563,918.50	0.70
5	600837	海通证券	27,552,173.32	0.60

6	000776	广发证券	27,344,647.16	0.59
7	601318	中国平安	24,503,532.38	0.53
8	601166	兴业银行	22,016,051.50	0.48
9	600015	华夏银行	21,836,773.14	0.47
10	601328	交通银行	21,384,453.57	0.46
11	601818	光大银行	21,097,655.17	0.46
12	601989	中国重工	21,030,254.95	0.46
13	600000	浦发银行	20,784,082.93	0.45
14	002304	洋河股份	18,946,207.91	0.41
15	601088	中国神华	18,872,592.12	0.41
16	600999	招商证券	15,727,541.46	0.34
17	601668	中国建筑	14,999,013.90	0.32
18	600030	中信证券	14,127,041.47	0.31
19	000858	五 粮 液	14,020,108.22	0.30
20	600519	贵州茅台	13,908,220.68	0.30

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。

#### 8.4.2 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	80,406,750.36	1.74
2	601988	中国银行	59,583,933.34	1.29
3	601328	交通银行	47,238,238.96	1.02
4	601318	中国平安	44,757,927.34	0.97
5	601288	农业银行	38,339,210.85	0.83
6	600016	民生银行	34,080,928.93	0.74
7	600000	浦发银行	33,957,517.32	0.74
8	601166	兴业银行	31,497,627.60	0.68
9	601088	中国神华	28,967,857.57	0.63
10	600030	中信证券	26,143,902.89	0.57
11	600015	华夏银行	23,220,784.23	0.50
12	000002	万 科 A	22,884,484.43	0.50
13	601601	中国太保	20,805,092.75	0.45
14	000858	五 粮 液	19,827,090.44	0.43
15	600519	贵州茅台	19,784,399.38	0.43

16	601989	中国重工	18,078,234.29	0.39
17	000001	深发展 A	15,877,515.68	0.34
18	600018	上港集团	15,529,604.54	0.34
19	601857	中国石油	15,054,594.06	0.33
20	002024	苏宁电器	14,738,192.91	0.32

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。

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,661,961,200.75
卖出股票的收入（成交）总额	2,012,268,467.66

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），不包含相关交易费用。

#### 8.5 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	96,820,000.00	2.95
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	96,820,000.00	2.95

#### 8.6 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	1101018	11 央行票据 18	1,000,000	96,820,000.00	2.95

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末没有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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,082,443.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,367,274.50
5	应收申购款	159,516.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,609,234.85

8.9.4 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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本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。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 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
73,921	65,799.00	1,713,157,561.10	35.22%	3,150,770,379.02	64.78%

9.2 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	7.24%
2	蒋云鹏	1,004,480.00	4.90%
3	张小玲	994,500.00	4.85%
4	许新梅	505,218.00	2.46%
5	于晓东	500,035.00	2.44%
6	青海旭阳机电有限公司	500,015.00	2.44%
7	姜新海	465,593.00	2.27%
8	李伟光	400,012.00	1.95%
9	赵新霞	336,726.00	1.64%
10	刘洋熙	308,418.00	1.50%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 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	279,182.91	0.01%

### §10 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	1,486,161,049.78
减：本报告期基金总赎回份额	1,835,639,020.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,863,927,940.12

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 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，经建信基金管理有限责任公司 2011 年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证监会，袁时奋先生当选为建信基金管理有限责任公司股东董事，欧阳伯权先生不再担任公司董事。

本报告期内托管人的基金托管部门未发生重大的人事变动。

#### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 110,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	2,229,161,216.84	61.04%	1,766,549.86	60.75%	-
渤海证券	1	924,354,624.68	25.31%	751,044.17	25.83%	-
财富证券	1	271,212,764.47	7.43%	210,471.21	7.24%	-
国泰君安证券	1	227,392,032.52	6.22%	179,779.03	6.18%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	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。

#### 11.7.2 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	3,204,394.90	100.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-

中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	2011-12-30
2	关于华泰联合证券退出开放式基金申购赎回代理券商的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-24
3	关于开通浦发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	2011-12-15
4	关于旗下开放式基金通过中信万通开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-09
5	关于新增天源证券为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-09
6	建信基金管理有限责任公司关于参加华泰证券股份有限公司开放式基金网上交易费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-11-10
7	关于旗下开放式基金通过华泰证券开办基金定投业务暨参加定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-11-10
8	关于新增申银万国证券为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-24
9	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	2011-08-23

10	关于旗下部分开放式基金通过长江证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-05
11	关于旗下部分开放式基金参加长江证券网上交易及手机证券交易系统基金申购(含定投)费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-05
12	关于开展建设银行借记卡网上直销申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-28
13	关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-15
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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

## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 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

二〇一二年三月三十日