

---

**建信深证 100 指数增强型证券投资基金**

**2012 年半年度报告**

**2012 年 6 月 30 日**

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 3 月 16 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	39
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.....	39
7.9 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	42
§11 备查文件目录 .....	43
11.1 备查文件目录 .....	43
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	建信深证100指数增强型证券投资基金
基金简称	建信深证100指数增强
基金主代码	530018
交易代码	530018
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	682,146,404.13份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对深证100指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以深证100指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，在控制与比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	张咏东
	联系电话	010-66228888	021-32169999
	电子邮箱	lucaiying@ccbfund.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路 188 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	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		100033	200120
法定代表人		江先周	胡怀邦

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-581,943.97
本期利润	-48,209,833.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0437
本期加权平均净值利润率	-4.41%
本期基金份额净值增长率	-7.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-51,212,460.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0751
期末基金资产净值	630,933,943.39
期末基金份额净值	0.9249
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-7.51%

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月；

2、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；

3、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）；

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.93%	1.10%	-7.20%	1.11%	0.27%	-0.01%
过去三个月	-7.57%	0.97%	0.81%	1.21%	-8.38%	-0.24%

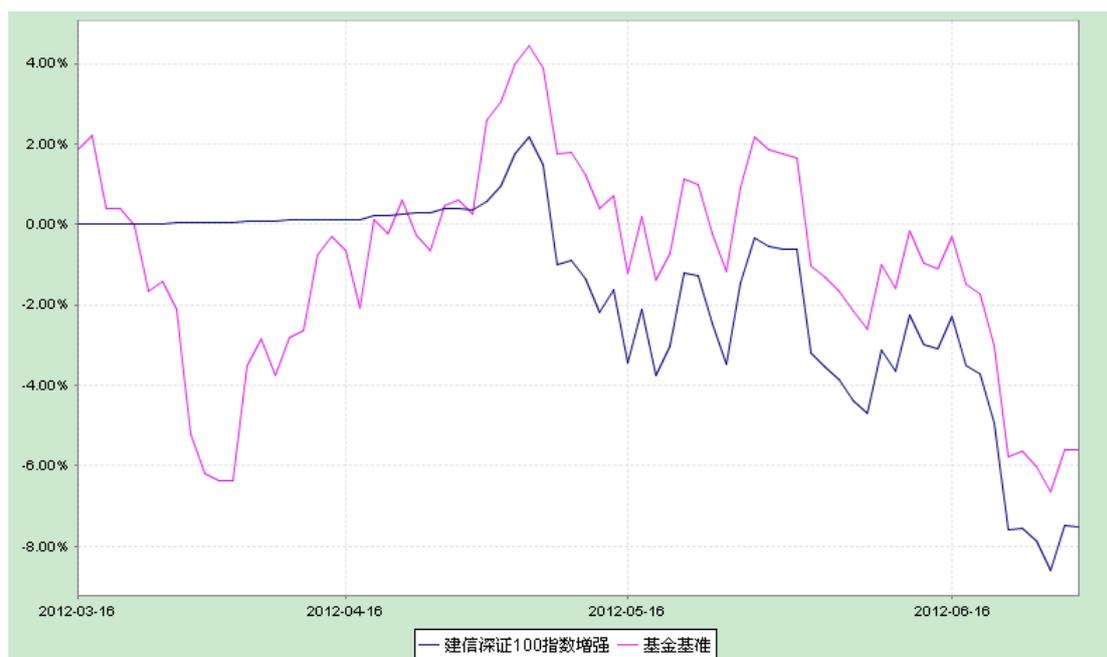
成立至今	-7.51%	0.88%	-5.59%	1.23%	-1.92%	-0.35%
------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

注：1、本基金于 2012 年 3 月 16 日生效，仍处于建仓期。

2、本基金投资业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。其中：深证 100 价格指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。深证 100 指数是中国证券市场第一只定位投资功能和代表多层次市场体系的指数。由深圳证券交易所委托深圳证券信息公司编制维护，此指数包含了深圳市场 A 股流通市值最大、成交最活跃的 100 只成份股。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信深证 100 指数增强型证券投资基金  
 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  
 （2012 年 3 月 16 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2012 年 3 月 16 日生效，仍处于建仓期。

## §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 2012 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金 22 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 475.31 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	2012-3-16	-	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8月加入建信基金管理有限责

					任公司，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。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任 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；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金成立于 2012 年一季度末，在二季度开始逐步建仓，本基金管理人以量化分析研究为基础，进行指数增强和风险管理，增强策略表现正常。在建仓基本完成后，超额收益的积累过程比较平稳。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

本报告期(本基金于 2012 年 3 月 16 日成立)本基金净值增长率-7.51%，波动率 0.88%，业绩比较基准收益率-5.59%，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**

在报告期间，指数曾经有反弹，但在经济基本面的压制下重回低点，展望 2012 年下半年，经济的基本面仍然不容乐观，各经济指标仍在低点徘徊，流动性虽有好转，但真实需求不足，预计指数上行压力仍大。

本基金管理人将根据基金合同，继续坚持量化分析研究，进一步完善指数增强策略，力争持续获取稳健的超额收益。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及

基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

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

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

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）。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于利润分配条款的规定。

### **§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**

2012 年上半年度，托管人在建信深证 100 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **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**

2012 年上半年度，建信基金管理有限公司在建信深证 100 指数增强型证券投资基金投资运作、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，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2012 年上半年度，由建信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关建信深证 100 指数增强型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,344,342.77
结算备付金		35,031,392.46
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	598,078,843.54
其中：股票投资		598,078,843.54
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	16,186.15
应收股利		-
应收申购款		233,005.04
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		635,703,769.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付赎回款		2,095,376.18
应付管理人报酬		545,906.88
应付托管费		109,181.37

应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,822,272.73
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	197,089.41
负债合计		4,769,826.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	682,146,404.13
未分配利润	6.4.7.10	-51,212,460.74
<b>所有者权益合计</b>		<b>630,933,943.39</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>635,703,769.96</b>

注：1.报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9249 元，基金份额总额 682,146,404.13 份。

2. 本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

## 6.2 利润表

会计主体：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 3 月 16 日（基金 合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-41,131,079.47</b>
1.利息收入		5,229,577.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	786,441.76
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,443,135.83
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,435,038.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,903,686.96
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	4,468,648.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-47,627,889.19

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,702,270.57
<b>减：二、费用</b>		<b>7,078,753.69</b>
1.管理人报酬		3,223,931.11
2.托管费		644,786.27
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.4.7.18	3,016,205.65
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	6.4.7.19	193,830.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-48,209,833.16</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-48,209,833.16</b>

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,747,440,444.36	-	1,747,440,444.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-48,209,833.16	-48,209,833.16
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）	-1,065,294,040.23	-3,002,627.58	-1,068,296,667.81
其中：1.基金申购款	1,091,192,489.13	2,322,803.10	1,093,515,292.23
2.基金赎回款	-2,156,486,529.36	-5,325,430.68	-2,161,811,960.04
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）	682,146,404.13	-51,212,460.74	630,933,943.39

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：孙志晨，主管会计工作负责人：何斌，会计机构负责

人：秦绪华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信深证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 2130 号《关于核准建信深证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》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《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2012 年 2 月 15 日至 2012 年 3 月 14 日止。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,747,241,015.70 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(2012)第 058 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,747,440,444.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 199,428.66 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票资产占基金资产的比例不低于 90%,其中,投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、

中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2012 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日止期间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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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，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，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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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。

#### **6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 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。

#### **6.4.4.11 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，但基金份额持有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。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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和债券,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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	2,344,342.77
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,344,342.77

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	645,706,732.73	598,078,843.54	-47,627,889.19
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	645,706,732.73	598,078,843.54	-47,627,889.19

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额,故未存在因此取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	1,153.64
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	15,032.51
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	16,186.15

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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 2012年6月30日

交易所市场应付交易费用	1,821,415.13
银行间市场应付交易费用	857.60
合计	1,822,272.73

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,896.89
预提费用	124,713.85
其他应付款	64,478.67
合计	197,089.41

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,747,440,444.36	1,747,440,444.36
本期申购	1,091,192,489.13	1,091,192,489.13
本期赎回（以“-”号填列）	-2,156,486,529.36	-2,156,486,529.36
本期末	682,146,404.13	682,146,404.13

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

3、本基金自 2012 年 2 月 15 日至 2012 年 3 月 14 日期间公开募集，基金合同生效日的基金份额总额为 1,747,440,444.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 199,428.66 份基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-581,943.97	-47,627,889.19	-48,209,833.16
本期基金份额交易产生的变动数	-2,325,116.67	-677,510.91	-3,002,627.58
其中：基金申购款	2,398,590.16	-75,787.06	2,322,803.10
基金赎回款	-4,723,706.83	-601,723.85	-5,325,430.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,907,060.64	-48,305,400.10	-51,212,460.74

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
活期存款利息收入	275,539.07
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	479,373.46
其他	31,529.23
合计	786,441.76

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
卖出股票成交总额	788,189,418.90
减：卖出股票成本总额	794,093,105.86
买卖股票差价收入	-5,903,686.96

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,468,648.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,468,648.52

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
1.交易性金融资产	-47,627,889.19
——股票投资	-47,627,889.19
——债券投资	-
——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	-47,627,889.19

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
基金赎回费收入	2,699,817.90
转换费收入	2,452.67
合计	2,702,270.57

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

3、本基金在转出时收取的转换费由本基金赎回费和适用情况下的申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
交易所市场交易费用	3,016,205.65
银行间市场交易费用	-
合计	3,016,205.65

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
审计费用	36,769.48
信息披露费	87,944.37
指数使用费	64,478.67
银行汇划费	3,738.14
其他	900.00
合计	193,830.66

注：本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日本基金未存在或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,223,931.11
其中：支付销售机构的客户维护费	1,950,935.68

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、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 1.0% 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 1.0% / 当年天数。

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至 2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	644,786.27

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月16日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,344,342.77	275,539.07

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

3、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2012 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金未发生其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2012 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
000059	辽通化工	2012-06-26	筹划重大事项	7.91	2012-07-03	8.15	1,237,989	11,360,670.97	9,792,492.99	-
合计		-		-	-	-	-	11,360,670.97	9,792,492.99	-

注：本基金截至 2012 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票指数增强型基金，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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。本基金为股票型指数增强基金，在对深证 100 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

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中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司管理层在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况

进行监督,管理层应如实向风险管理委员会汇报有关风险控制情况;以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面,风险管理部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制;监察稽核部承担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。

#### **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同责任,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交通银行,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 2012 年 6 月 30 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占基金资产净值的比例为 0.00%。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一

方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过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。本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,344,342.77	-	-	-	2,344,342.77
结算倍付金	35,031,392.46	-	-	-	35,031,392.46
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	598,078,843.54	598,078,843.54
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	-	-	-	16,186.15	16,186.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	233,005.04	233,005.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,375,735.23	-	-	598,328,034.73	635,703,769.96
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,095,376.18	2,095,376.18
应付管理人报酬	-	-	-	545,906.88	545,906.88
应付托管费	-	-	-	109,181.37	109,181.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,822,272.73	1,822,272.73
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	197,089.41	197,089.41

负债总计	-	-	-	4,769,826.57	4,769,826.57
利率敏感度缺口	37,375,735.23	-	-	593,558,208.16	630,933,943.39

注：1、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。

2、本基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至报告截止日 2012 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	598,078,843.54	94.79
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	598,078,843.54	94.79

注：本基金合同自 2012 年 3 月 16 日生效，至报告截止日 2012 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金仍处于建仓期，尚无足够经验数据。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (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 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 588,286,350.55 元，属于第二层级的余额为 9,792,492.99 元，无属于第三层级的余额。

##### (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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	598,078,843.54	94.08
	其中：股票	598,078,843.54	94.08
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	37,375,735.23	5.88
6	其他各项资产	249,191.19	0.04
7	合计	635,703,769.96	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	31,917,898.92	5.06
C	制造业	298,001,370.32	47.23
C0	食品、饮料	77,302,619.21	12.25
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	15,815,216.98	2.51
C5	电子	10,871,843.84	1.72
C6	金属、非金属	64,203,394.83	10.18
C7	机械、设备、仪表	101,993,583.20	16.17
C8	医药、生物制品	27,814,712.26	4.41
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,443,824.20	1.02
E	建筑业	5,874,990.00	0.93
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,668,686.76	2.01
H	批发和零售贸易	13,635,307.50	2.16
I	金融、保险业	47,825,004.37	7.58
J	房地产业	53,552,305.11	8.49
K	社会服务业	9,326,979.42	1.48
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	15,548,119.08	2.46
	合计	494,794,485.68	78.42

注：以上行业分类以 2012 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 7.2.2 积极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	-	-
B	采掘业	3,641,314.00	0.58
C	制造业	41,069,172.06	6.51
C0	食品、饮料	6,374,984.00	1.01
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	391,818.00	0.06
C3	造纸、印刷	1,562,400.60	0.25
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,581,077.17	0.88
C5	电子	1,840,146.39	0.29
C6	金属、非金属	7,370,614.42	1.17
C7	机械、设备、仪表	17,948,131.48	2.84
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,565,473.20	1.04
F	交通运输、仓储业	453,435.00	0.07
G	信息技术业	4,235,375.14	0.67
H	批发和零售贸易	21,177,266.29	3.36
I	金融、保险业	7,539,361.45	1.19
J	房地产业	12,355,874.72	1.96
K	社会服务业	1,188,043.00	0.19
L	传播与文化产业	1,592,209.00	0.25
M	综合类	3,466,834.00	0.55
	合计	103,284,357.86	16.37

注：以上行业分类以 2012 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	3,575,414	31,856,938.74	5.05
2	000858	五粮液	867,190	28,409,144.40	4.50
3	000651	格力电器	1,356,952	28,292,449.20	4.48
4	000157	中联重科	2,017,031	20,230,820.93	3.21
5	000001	深发展A	1,245,821	18,886,646.36	2.99
6	000776	广发证券	604,333	18,027,253.39	2.86
7	000568	泸州老窖	394,939	16,709,869.09	2.65
8	000338	潍柴动力	441,225	13,099,970.25	2.08
9	000876	新希望	865,380	12,963,392.40	2.05
10	000527	美的电器	1,117,463	12,347,966.15	1.96
11	000060	中金岭南	1,425,184	12,285,086.08	1.95
12	002024	苏宁电器	1,415,990	11,880,156.10	1.88
13	002008	大族激光	1,861,763	11,691,871.64	1.85
14	000629	攀钢钒钛	1,767,963	11,633,196.54	1.84
15	000933	神火股份	1,267,622	11,560,712.64	1.83
16	000402	金融街	1,676,749	10,949,170.97	1.74
17	000970	中科三环	273,988	10,871,843.84	1.72
18	002304	洋河股份	79,184	10,654,207.20	1.69
19	000630	铜陵有色	547,087	10,558,779.10	1.67
20	000063	中兴通讯	736,005	10,274,629.80	1.63
21	000059	辽通化工	1,237,989	9,792,492.99	1.55
22	002146	荣盛发展	870,666	9,490,259.40	1.50
23	000069	华侨城A	1,461,909	9,326,979.42	1.48
24	000623	吉林敖东	458,149	7,944,303.66	1.26
25	000839	中信国安	1,162,600	7,812,672.00	1.24
26	000937	冀中能源	503,195	7,683,787.65	1.22
27	000423	东阿阿胶	169,537	6,783,175.37	1.08
28	000539	粤电力A	976,337	6,443,824.20	1.02
29	000783	长江证券	701,378	6,382,539.80	1.01
30	002081	金螳螂	154,605	5,874,990.00	0.93
31	000895	双汇发展	94,844	5,868,946.72	0.93
32	002001	新和成	276,073	5,833,422.49	0.92
33	000550	江铃汽车	272,113	5,809,612.55	0.92
34	000778	新兴铸管	838,146	5,607,196.74	0.89
35	000969	安泰科技	449,522	5,497,654.06	0.87
36	000425	徐工机械	374,283	5,367,218.22	0.85
37	000039	中集集团	328,648	4,371,018.40	0.69
38	002007	华兰生物	175,957	4,325,023.06	0.69
39	000877	天山股份	433,469	4,226,322.75	0.67
40	000422	湖北宜化	342,065	4,190,296.25	0.66
41	002073	软控股份	464,277	3,890,641.26	0.62
42	000758	中色股份	202,803	3,847,172.91	0.61
43	000009	中国宝安	357,213	3,572,130.00	0.57
44	000652	泰达股份	782,988	3,061,483.08	0.49
45	000538	云南白药	49,406	2,928,787.68	0.46

46	000401	冀东水泥	206,870	2,908,592.20	0.46
47	002128	露天煤业	217,623	2,846,508.84	0.45
48	000825	太钢不锈	793,247	2,800,161.91	0.44
49	000562	宏源证券	152,082	2,515,436.28	0.40
50	000983	西山煤电	154,920	2,416,752.00	0.38
51	000021	长城开发	444,992	2,394,056.96	0.38
52	000786	北新建材	147,475	1,908,326.50	0.30
53	000780	平庄能源	179,127	1,877,250.96	0.30
54	000792	盐湖股份	54,262	1,832,427.74	0.29
55	000829	天音控股	269,195	1,755,151.40	0.28
56	000930	中粮生化	355,800	1,729,188.00	0.27
57	002155	辰州矿业	87,072	1,685,713.92	0.27
58	002142	宁波银行	161,299	1,609,764.02	0.26
59	000559	万向钱潮	251,100	1,263,033.00	0.20
60	000024	招商地产	51,200	1,255,936.00	0.20
61	000709	河北钢铁	443,113	1,209,698.49	0.19
62	000540	中天城投	149,300	1,101,834.00	0.17
63	000612	焦作万方	90,226	1,047,523.86	0.17
64	000869	张裕A	14,390	967,871.40	0.15
65	000728	国元证券	36,972	403,364.52	0.06
66	000960	锡业股份	7,606	149,838.20	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000537	广宇发展	1,269,573	9,128,229.87	1.45
2	600166	福田汽车	1,012,906	7,242,277.90	1.15
3	600827	友谊股份	624,385	7,061,794.35	1.12
4	000028	国药一致	231,213	6,885,523.14	1.09
5	000799	酒鬼酒	121,660	6,374,984.00	1.01
6	600104	上汽集团	430,120	6,146,414.80	0.97
7	600016	民生银行	862,600	5,166,974.00	0.82
8	002470	金正大	358,403	4,745,255.72	0.75
9	600219	南山铝业	545,407	3,654,226.90	0.58
10	601668	中国建筑	1,049,230	3,504,428.20	0.56
11	002344	海宁皮城	131,339	3,425,321.12	0.54
12	600875	东方电气	181,777	3,257,443.84	0.52
13	600881	亚泰集团	557,300	3,065,150.00	0.49
14	000066	长城电脑	753,481	2,968,715.14	0.47
15	600019	宝钢股份	624,952	2,699,792.64	0.43
16	000616	亿城股份	564,700	2,066,802.00	0.33
17	002140	东华科技	101,200	1,948,100.00	0.31
18	000963	华东医药	61,700	1,863,340.00	0.30
19	601898	中煤能源	236,700	1,832,058.00	0.29
20	600880	博瑞传播	159,700	1,592,209.00	0.25
21	002078	太阳纸业	270,780	1,562,400.60	0.25
22	000987	广州友谊	110,544	1,461,391.68	0.23

23	000050	深天马 A	217,424	1,419,778.72	0.23
24	600050	中国联通	340,500	1,266,660.00	0.20
25	601117	中国化学	205,900	1,188,043.00	0.19
26	601186	中国铁建	250,100	1,112,945.00	0.18
27	600348	阳泉煤业	69,080	1,056,924.00	0.17
28	600582	天地科技	62,574	904,194.30	0.14
29	600030	中信证券	66,605	841,221.15	0.13
30	000683	远兴能源	147,933	835,821.45	0.13
31	601899	紫金矿业	193,900	752,332.00	0.12
32	601169	北京银行	69,400	678,038.00	0.11
33	000708	大冶特钢	67,424	614,906.88	0.10
34	000006	深振业 A	96,097	548,713.87	0.09
35	601006	大秦铁路	64,500	453,435.00	0.07
36	600060	海信电器	25,007	420,367.67	0.07
37	600362	江西铜业	16,800	401,688.00	0.06
38	600811	东方集团	73,300	401,684.00	0.06
39	002242	九阳股份	54,049	397,800.64	0.06
40	000910	大亚科技	79,800	391,818.00	0.06
41	000926	福星股份	36,697	342,749.98	0.05
42	601998	中信银行	84,600	338,400.00	0.05
43	600816	安信信托	17,665	293,592.30	0.05
44	600694	大商股份	8,700	291,015.00	0.05
45	002244	滨江集团	29,700	269,379.00	0.04
46	600000	浦发银行	27,200	221,136.00	0.04
47	002277	友阿股份	12,100	188,881.00	0.03

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	50,685,527.52	8.03
2	000858	五粮液	44,950,389.02	7.12
3	000157	中联重科	40,400,816.47	6.40
4	000568	泸州老窖	35,471,194.91	5.62
5	000651	格力电器	34,729,292.72	5.50
6	002024	苏宁电器	32,352,103.41	5.13
7	000776	广发证券	27,513,613.08	4.36
8	000001	深发展 A	26,353,047.23	4.18
9	000970	中科三环	26,241,384.13	4.16
10	000425	徐工机械	25,608,079.08	4.06
11	000060	中金岭南	24,107,380.49	3.82
12	000933	神火股份	23,095,069.52	3.66
13	000063	中兴通讯	22,541,370.31	3.57
14	000527	美的电器	22,465,069.00	3.56
15	002304	洋河股份	21,615,288.60	3.43
16	002146	荣盛发展	21,010,129.27	3.33
17	000877	天山股份	20,983,050.60	3.33
18	000629	攀钢钒钛	18,985,573.03	3.01

19	000969	安泰科技	18,497,383.22	2.93
20	000937	冀中能源	18,451,199.51	2.92
21	002001	新 和 成	18,256,631.03	2.89
22	002008	大族激光	17,999,105.94	2.85
23	000876	新 希 望	17,763,872.44	2.82
24	000059	辽通化工	17,693,009.15	2.80
25	000550	江铃汽车	17,584,204.88	2.79
26	000630	铜陵有色	17,536,729.02	2.78
27	000338	潍柴动力	16,506,319.79	2.62
28	601668	中国建筑	16,275,767.80	2.58
29	000839	中信国安	16,102,788.08	2.55
30	000537	广宇发展	15,899,805.14	2.52
31	000422	湖北宜化	14,997,644.83	2.38
32	000069	华侨城 A	14,838,357.00	2.35
33	002081	金 螳 螂	14,659,617.62	2.32
34	000709	河北钢铁	14,581,560.40	2.31
35	000423	东阿阿胶	14,496,098.08	2.30
36	000418	小天鹅 A	14,450,716.17	2.29
37	000402	金 融 街	14,364,595.10	2.28
38	600887	伊利股份	14,182,715.64	2.25
39	002007	华兰生物	14,116,143.12	2.24
40	002073	软控股份	14,106,968.77	2.24
41	000895	双汇发展	14,055,268.46	2.23
42	000786	北新建材	13,726,522.88	2.18
43	002155	辰州矿业	13,681,440.03	2.17
44	000878	云南铜业	13,615,115.12	2.16
45	000683	远兴能源	12,860,669.47	2.04
46	000825	太钢不锈	12,777,609.44	2.03

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000157	中联重科	19,971,768.94	3.17
2	000425	徐工机械	19,098,181.69	3.03
3	000970	中科三环	18,443,836.71	2.92
4	002024	苏宁电器	18,232,024.66	2.89
5	000002	万 科 A	18,095,485.73	2.87
6	000568	泸州老窖	17,332,711.41	2.75
7	000877	天山股份	16,004,745.58	2.54
8	000418	小天鹅 A	14,665,454.24	2.32
9	600887	伊利股份	14,394,731.76	2.28
10	000858	五 粮 液	13,891,687.24	2.20
11	000878	云南铜业	13,803,619.51	2.19
12	002001	新 和 成	13,283,540.51	2.11
13	601668	中国建筑	12,589,478.09	2.00
14	000709	河北钢铁	12,475,688.00	1.98
15	002155	辰州矿业	12,391,640.12	1.96

16	000969	安泰科技	11,991,942.45	1.90
17	000550	江铃汽车	11,243,160.90	1.78
18	000786	北新建材	11,143,925.82	1.77
19	000683	远兴能源	11,001,702.04	1.74
20	002146	荣盛发展	10,940,101.27	1.73

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,439,799,838.59
卖出股票收入（成交）总额	788,189,418.90

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

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

**7.9.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,186.15
5	应收申购款	233,005.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,191.19

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.9.5.2 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。

### §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
12,855	53,064.68	68,061,811.33	9.98%	614,084,592.80	90.02%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，本基金管理公司的从业人员未持有本基金。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 3 月 16 日）基金份额总额	1,747,440,444.36
本报告期基金总申购份额	1,091,192,489.13
减：本报告期基金总赎回份额	2,156,486,529.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	682,146,404.13

注：1、本基金基金合同自 2012 年 3 月 16 日起生效，至 2012 年 6 月 30 日未满六个月。

2、总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2012 年 3 月 28 日，公司 2012 年度第一次临时股东会审议通过了《关于选举建信基金管理有限责任公司第三届董事会董事的议案》，同意江先周、孙志晨、马梅琴、俞斌、袁时奋、殷红军、顾建国、王建国、伏军为公司第三届董事会董事，第二届董事会成员关启昌、沈四宝不再担任公司独立董事。

基金托管人交通银行于 2012 年 5 月 28 日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在 2012 年 5 月 30 日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	904,400,896.10	40.59%	734,829.90	40.34%	-
中投证券	1	636,352,403.32	28.56%	531,438.47	29.18%	-
华创证券	1	386,401,189.05	17.34%	313,953.13	17.24%	-
光大证券	1	214,705,652.08	9.64%	173,541.02	9.53%	-
齐鲁证券	1	86,129,116.94	3.87%	67,652.61	3.71%	-

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、本基金合同于 2012 年 3 月 16 日正式生效，本期新增招商证券、中投证券、华创证券、光大证券及齐鲁证券各一个交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		股指期货交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	成交金额	占当期成交总额的比例	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
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	400,042,000.00	3.25%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	11,902,500,000.00	96.75%	-	-	-	-

### 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	建信基金管理有限责任公司关于开展直销网上交易基金转换费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-06-28
2	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	2012-06-27
3	关于公司旗下部分开放式基金开通跨TA转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-05-29
4	建信基金管理有限责任公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费	指定报刊和/或公司网站	2012-05-23

	率的公告		
5	建信深证100指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及基金转换业务公告	指定报刊和/或公司网站	2012-04-13
6	建信深证100指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2012-03-17
7	关于新增上海证券、中信证券（浙江）及中信万通为建信深证100指数增强型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-03-02
8	关于建信深证100指数增强型证券投资基金招募说明书的更正公告	指定报刊和/或公司网站	2012-02-11

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信深证 100 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

二〇一二年八月二十八日