

南方沪深 300 指数证券投资基金 2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2010 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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 2010 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§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	34
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	35
7.4 报告期内权益投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	45
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	45
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	45
7.9 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
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	48
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	49
10.8 其他重大事件	50
§11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录	52
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 指数证券投资基金
基金简称	南方沪深 300 指数
基金主代码	202015
前端交易代码	202015
后端交易代码	202016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
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	1,391,560,774.72 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 300”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律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比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%,以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用指数复制法,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,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 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,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	蒋松云
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

§ 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(2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-10,428,933.51
本期利润	-533,762,606.28
加权平均基金份额本期利润	-0.3436
本期加权平均净值利润率	-29.27%
本期基金份额净值增长率	-27.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-53,707,516.69
期末可供分配基金份额利润	-0.0386
期末基金资产净值	1,337,853,258.03
期末基金份额净值	0.961
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.26%

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

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

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

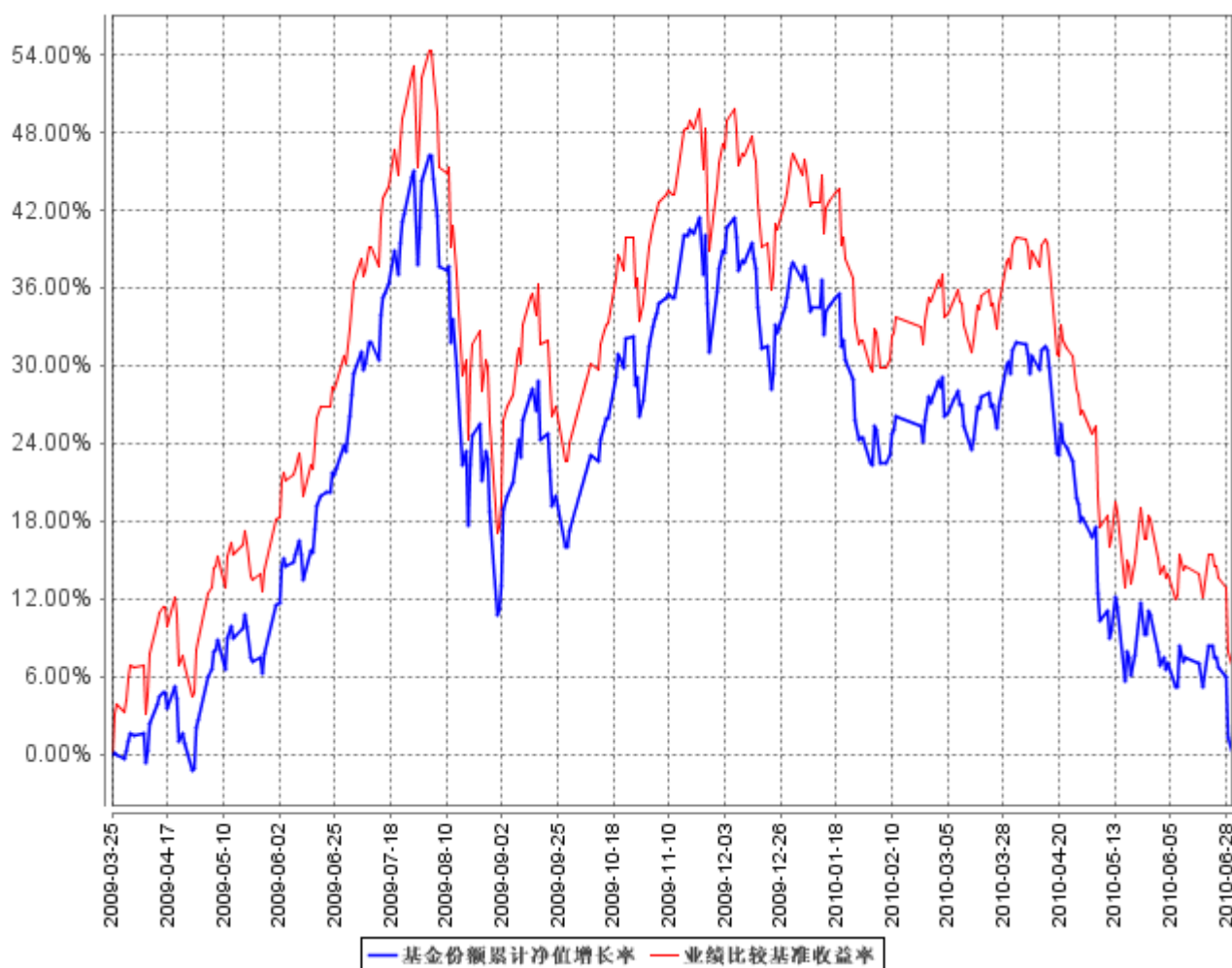
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.15%	1.61%	-7.21%	1.59%	0.06%	0.02%
过去三个月	-22.56%	1.75%	-22.33%	1.73%	-0.23%	0.02%
过去六个月	-27.36%	1.53%	-27.05%	1.51%	-0.31%	0.02%
过去一年	-18.75%	1.81%	-17.91%	1.81%	-0.84%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.26%	1.72%	6.80%	1.75%	-6.54%	-0.03%

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

基金份额累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图



注：由于本基金正式跟踪标的指数起始日为 2009 年 5 月 1 日，因此上图未能体现本基金建仓期之后拟合业绩基准的情况。

§ 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

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[1998]4 号文批准,由南方证券股份有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年,经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股,注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年,经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股,注册资本达 1.5 亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司 45%、深圳市机场(集团)有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

截至报告期末,公司管理资产规模约 1,600 亿元,管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元;20 只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金,南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金(QDII 基金)、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型证券投资基金、南方沪深 300 指数证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金、深证成份交易型开放式指数证券投资基金、南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金和南方策略优化股票型证券投资基金;以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘海宁	本基金的基金经理	2009 年 3 月 25 日	-	9 年	会计学学士,具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003 年 3 月加入南方基金,历任行业研究员、基金开元经理助理、投资部总监助理等职务。2009 年 3 月至今,任南方 300 指数基金经理;2009 年 12 月至今,任南方深成 ETF 及联接基金基金经理。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则, 并严格按照《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的各项规定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求与标的指数相近的收益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 完善相应制度及流程, 通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行, 公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

2010 年上半年, 伴随着货币政策的收紧引发了市场对流动性的担忧, 投资者对大盘蓝筹股普遍缺乏信心, 沪深 300 指数上半年基本呈现单边下跌走势, 指数涨幅为-28.32%。期间本基金申购赎回波动略大, 但我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等, 将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平。

对于指数基金而言, 现行的份额净值计算精度(即四舍五入保留小数点后 3 位)所带来的跟踪误差是不容忽视的, 依然是本基金跟踪误差的主要来源之一, 为更好地拟合标的指数, 保障基金份额持有人的利益, 我们在与各方协商一致后, 自 2010 年 7 月 2 日起, 已将本基金份额净值计算精度提高到了小数点后 4 位; 此外, 跟踪误差另一重要来源即申购赎回波动带来的影响。

7 月 1 日, 沪深 300 指数进行了半年度的成份股例行调整, 本基金管理组提前进行了全面模拟测算, 并制定了周密的调仓方案, 从实施结果来看, 本基金成份股调仓较为成功, 并藉此取得了相对业绩基准的适度正向超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，报告期内本基金相对于业绩基准的跟踪误差为 0.069%，年化跟踪误差为 1.092%，自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为 0.877%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.961 元，报告期内，份额净值增长率为-27.36%，同期业绩基准增长率为-27.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济面临多层次的转型，从历史上看，在经济转型过程中，资本市场反映出来的多以振荡为主。A 股沪指自 2009 年 8 月创出 3478 点反弹新高后，一直处于振荡下行过程中，经过今年上半年大幅下跌之后，6 月末市场整体 PE 水平已经相当于 2005 年的 998 点和 2008 年的 1664 点左右的水平，市场估值已经处于历史底部区域。5 月份上市公司大股东增持金额达到减持金额的 1.68 倍，为 2008 年 10 月以来的首次月度净增持，体现了产业资本对 A 股当前估值水平的认可。AH 股溢价指数跌破 100，创近 4 年新低，说明与国际资本市场估值水平比较，A 股市场的估值也已处于低位。一旦政策面和资金面有所改善，下半年市场将在震荡筑底的过程中酝酿回升机会，而在此前提下，指数基金将体现出其高仓位的优势。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。长期而言，我们认为通过本基金进行定期定投不失为一种较为省心省力的投资方式。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、量化投资部总监、

监察稽核总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

§ 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

2010 年上半年，本基金托管人在对南方沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年上半年，南方沪深 300 指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、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，南方沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方沪深 300 指数证券投资基金 2010 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

二〇一〇年八月二十日

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	73,528,234.38	114,214,266.36
结算备付金		659,427.18	1,378,564.76
存出保证金		408,026.19	1,060,650.85
交易性金融资产	6.4.4.2	1,257,413,994.31	2,024,690,883.62
其中：股票投资		1,257,413,994.31	2,024,690,883.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		8,368,560.94	-
应收利息	6.4.4.5	12,901.91	20,330.94
应收股利		624,686.30	-
应收申购款		3,200,302.38	102,277,405.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,344,216,133.59	2,243,642,102.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,910,487.78	80,770,931.39
应付赎回款		732,449.25	8,424,510.16
应付管理人报酬		755,434.12	1,108,933.12
应付托管费		174,330.97	255,907.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	1,584,027.32	1,090,169.42
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	206,146.12	118,170.95
负债合计		6,362,875.56	91,768,622.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	1,391,560,774.72	1,625,937,096.08
未分配利润	6.4.4.10	-53,707,516.69	525,936,383.66
所有者权益合计		1,337,853,258.03	2,151,873,479.74
负债和所有者权益总计		1,344,216,133.59	2,243,642,102.42

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.961 元，基金份额总额 1,391,560,774.72 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 3 月 25 日(基 金合同生效日) 至 2009 年 6 月 30 日
一、收入		-524,570,764.96	288,858,918.55
1. 利息收入		366,589.12	637,665.97
其中：存款利息收入	6.4.4.11	358,893.90	637,665.97
债券利息收入		2,139.62	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,555.60	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,553,442.03	69,162,114.40
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-11,145,697.23	61,558,769.28
债券投资收益	6.4.4.13	30,894.88	-
资产支持证券投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	8,561,360.32	7,603,345.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-523,333,672.77	217,585,773.13
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	949,760.72	1,473,365.05
减：二、费用		9,191,841.32	5,795,801.83
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	5,885,606.34	2,354,393.28
2. 托管费	6.4.7.2.2	1,358,216.89	543,321.52
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	1,740,293.47	2,785,372.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	207,724.62	112,714.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-533,762,606.28	283,063,116.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-533,762,606.28	283,063,116.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,625,937,096.08	525,936,383.66	2,151,873,479.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-533,762,606.28	-533,762,606.28
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)	-234,376,321.36	-45,881,294.07	-280,257,615.43
其中：1. 基金申购款	413,183,671.23	76,703,425.33	489,887,096.56
2. 基金赎回款	-647,559,992.59	-122,584,719.40	-770,144,711.99
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)	1,391,560,774.72	-53,707,516.69	1,337,853,258.03
项目	上年度可比期间 2009 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2009 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)	1,580,754,997.47	-	1,580,754,997.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	283,063,116.72	283,063,116.72
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)	-464,410,412.17	-22,395,844.39	-486,806,256.56
其中：1. 基金申购款	611,759,398.10	80,111,382.39	691,870,780.49
2. 基金赎回款	-1,076,169,810.27	-102,507,226.78	-1,178,677,037.05
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)	1,116,344,585.30	260,667,272.33	1,377,011,857.63

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人 高良玉

主管会计工作负责人 鲍文革

会计机构负责人 鲍文革

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日	
	活期存款	73,528,234.38
定期存款	-	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
其他存款	-	
合计：	73,528,234.38	

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,523,117,755.31	1,257,413,994.31	-265,703,761.00
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,523,117,755.31	1,257,413,994.31	-265,703,761.00

注：于 2010 年 6 月 30 日，股票投资余额中包括按照指数收益法估值(附注 6.4.9.2)的特殊事项停牌相关股票 4,816,663.50 元；采用该估值技术的股票投资于本半年度利润表中确认的公允价值变动损失为-763,900.50 元。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

期末相关项目余额为零。

6.4.4.4 买入返售金融资产

期末相关项目余额为零。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	12,694.19
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	207.72
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	12,901.91

6.4.4.6 其他资产

期末相关项目余额为零。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,584,027.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,584,027.32

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,290.03
预提费用	202,856.09
合计	206,146.12

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,625,937,096.08	1,625,937,096.08
本期申购	413,183,671.23	413,183,671.23
本期赎回(以“-”号填列)	-647,559,992.59	-647,559,992.59
本期末	1,391,560,774.72	1,391,560,774.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.4.10 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	174,194,555.27	351,741,828.39	525,936,383.66
本期利润	-10,428,933.51	-523,333,672.77	-533,762,606.28
本期基金份额交易产生的变动数	-26,227,726.48	-19,653,567.59	-45,881,294.07
其中：基金申购款	44,226,706.18	32,476,719.15	76,703,425.33
基金赎回款	-70,454,432.66	-52,130,286.74	-122,584,719.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,537,895.28	-191,245,411.97	-53,707,516.69

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
活期存款利息收入	342,058.77
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	6,013.52
其他	10,821.61
合计	358,893.90

6.4.4.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出股票成交总额	649,972,755.10
减：卖出股票成本总额	661,118,452.33
买卖股票差价收入	-11,145,697.23

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,545,034.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,512,000.00
减：应收利息总额	2,139.62
债券投资收益	30,894.88

6.4.4.14 资产支持证券投资收益

本期无资产支持证券投资收益。

6.4.4.15 衍生工具收益

本期无衍生工具收益。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,561,360.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,561,360.32

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-523,333,672.77
——股票投资	-523,333,672.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-523,333,672.77

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	835,895.82
基金转换费收入	113,864.90
合计	949,760.72

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,740,293.47
银行间市场交易费用	-
合计	1,740,293.47

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
审计费用		49,588.57
信息披露费		148,767.52
银行费用		368.53
帐户维护费		9,000.00
合计		207,724.62

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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未发生变化。

6.4.6.2 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
南方基金管理有限公司（“南方基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年3月25日（基金合同生效日） 至2009年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华泰证券	6,902,803.49	0.65	45,468,623.89	2.12
兴业证券	-	-	231,014,203.36	10.77

6.4.7.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例(%)
华泰证券	5,867.66	0.66	5,867.66	0.37
兴业证券	-	-	15,495.95	0.98
关联方名称	上年度可比期间 2009年3月25日（基金合同生效日）至2009年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例(%)
华泰证券	36,943.41	2.05	36,943.41	2.05
兴业证券	187,700.99	10.41	187,700.99	10.41

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年3月25日 (基金合同生效日)至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,885,606.34	2,354,393.28
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,026,204.74	371,285.24

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，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 × 0.65% ÷ 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年3月25日 (基金合同生效日)至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,358,216.89	543,321.52

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 3 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2009 年 6 月 30 日
基金合同生效日 (2009 年 3 月 25 日) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	40,967,717.14	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	40,967,717.14	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.94%	-

注：期间申购总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回总份额含转换出份额。

6.4.7.4.2 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

无。

6.4.7.5 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2009 年 3 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2009 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	73,528,234.38	342,058.77	91,476,030.69	623,879.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

6.4.9 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
无										

6.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
无										

6.4.9.1.3 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
无										

6.4.9.2 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
600675	中华企业	2010年5月17日	重大事项公告	7.18	-	-	296,425	3,211,094.65	2,128,331.50	
600816	安信信托	2010年6月2日	重大事项公告	13.60	-	-	96,050	1,677,071.96	1,306,280.00	
601318	中国平安	2010年6月29日	重大事项公告	46.81	-	-	873,269	43,174,542.66	40,877,721.89	
000001	深发展A	2010年6月30日	重大事项公告	17.51	-	-	944,300	19,443,462.60	16,534,693.00	
000895	双汇发展	2010年3月22日	重大事项公告	43.57	-	-	110,550	4,383,807.87	4,816,663.50	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

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。

6.4.10.2 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行中国工商银行，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.9.2 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，其余金融资产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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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及结算备付金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 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	73,528,234.38	-	-	-	73,528,234.38
结算备付金	659,427.18	-	-	-	659,427.18
存出保证金	-	-	-	408,026.19	408,026.19
交易性金融资产	-	-	-	1,257,413,994.31	1,257,413,994.31
应收证券清算款	-	-	-	8,368,560.94	8,368,560.94
应收利息	-	-	-	12,901.91	12,901.91
应收股利	-	-	-	624,686.30	624,686.30
应收申购款	-	-	-	3,200,302.38	3,200,302.38
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	74,187,661.56	-	-	1,270,028,472.03	1,344,216,133.59
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,910,487.78	2,910,487.78
应付赎回款	-	-	-	732,449.25	732,449.25
应付管理人报酬	-	-	-	755,434.12	755,434.12
应付托管费	-	-	-	174,330.97	174,330.97
应付交易费用	-	-	-	1,584,027.32	1,584,027.32
其他负债	-	-	-	206,146.12	206,146.12
负债总计	-	-	-	6,362,875.56	6,362,875.56
利率敏感度缺口	74,187,661.56	-	-	1,263,665,596.47	1,337,853,258.03
上年度末 2009 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	114,214,266.36	-	-	-	114,214,266.36
结算备付金	1,378,564.76	-	-	-	1,378,564.76
存出保证金	-	-	-	1,060,650.85	1,060,650.85
交易性金融资产	-	-	-	2,024,690,883.62	2,024,690,883.62
应收利息	-	-	-	20,330.94	20,330.94
应收申购款	-	-	-	102,277,405.89	102,277,405.89
资产总计	115,592,831.12	-	-	2,128,049,271.30	2,243,642,102.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	80,770,931.39	80,770,931.39
应付赎回款	-	-	-	8,424,510.16	8,424,510.16
应付管理人报酬	-	-	-	1,108,933.12	1,108,933.12
应付托管费	-	-	-	255,907.64	255,907.64
应付交易费用	-	-	-	1,090,169.42	1,090,169.42
其他负债	-	-	-	118,170.95	118,170.95
负债总计	-	-	-	91,768,622.68	91,768,622.68
利率敏感度缺口	115,592,831.12	-	-	2,036,280,648.62	2,151,873,479.74

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 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。

6.4.10.4.3 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，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。本基金资产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（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日		上年度末 2009 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	1,257,413,994.31	93.99	2,024,690,883.62	94.09
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,257,413,994.31	93.99	2,024,690,883.62	94.09

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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：人民币万元）	
		本期末（2010 年 6 月 30 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 6,562.00	-
沪深 300 指数下降 5%	减少约 6,562.00	-	

注：于 2009 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,257,413,994.31	93.54
	其中：股票	1,257,413,994.31	93.54
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	74,187,661.56	5.52
6	其他各项资产	12,614,477.72	0.94
7	合计	1,344,216,133.59	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,006,333.94	0.37
B	采掘业	130,944,171.74	9.79
C	制造业	375,539,197.94	28.07
C0	食品、饮料	58,628,116.46	4.38
C1	纺织、服装、皮毛	5,264,576.05	0.39
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,447,008.80	0.26
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,230,165.78	1.96
C5	电子	6,610,565.05	0.49
C6	金属、非金属	97,380,358.89	7.28
C7	机械、设备、仪表	125,431,570.57	9.38
C8	医药、生物制品	46,699,795.99	3.49
C99	其他制造业	5,847,040.35	0.44
D	电力、煤气及水的生产和供应业	48,269,587.46	3.61
E	建筑业	44,851,789.85	3.35
F	交通运输、仓储业	58,943,080.16	4.41
G	信息技术业	44,755,351.31	3.35
H	批发和零售贸易	40,071,023.11	3.00
I	金融、保险业	402,162,732.58	30.06
J	房地产业	68,555,219.46	5.12
K	社会服务业	12,566,643.86	0.94
L	传播与文化产业	2,891,940.00	0.22
M	综合类	22,856,922.90	1.71
	合计	1,257,413,994.31	93.99

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	3,663,338	47,660,027.38	3.56
2	601318	中国平安	873,269	40,877,721.89	3.06
3	601328	交通银行	6,535,188	39,276,479.88	2.94
4	600016	民生银行	5,576,016	33,734,896.80	2.52
5	601166	兴业银行	1,242,617	28,617,469.51	2.14
6	600000	浦发银行	2,040,273	27,747,712.80	2.07
7	601939	建设银行	5,534,600	26,012,620.00	1.94
8	600030	中信证券	2,062,338	24,129,354.60	1.80
9	601088	中国神华	977,023	21,465,195.31	1.60
10	601601	中国太保	931,178	21,202,923.06	1.58
11	000002	万科A	2,867,650	19,442,667.00	1.45
12	000001	深发展A	944,300	16,534,693.00	1.24
13	600900	长江电力	1,303,432	16,279,865.68	1.22
14	601169	北京银行	1,291,376	15,664,390.88	1.17
15	600519	贵州茅台	111,858	14,246,234.88	1.06
16	002024	苏宁电器	1,243,500	14,175,900.00	1.06
17	000858	五粮液	562,260	13,623,559.80	1.02
18	600050	中国联通	2,511,609	13,386,875.97	1.00
19	601668	中国建筑	3,554,800	12,477,348.00	0.93
20	601857	中国石油	1,113,082	11,409,090.50	0.85
21	600837	海通证券	1,218,680	11,041,240.80	0.83
22	601628	中国人寿	444,371	10,975,963.70	0.82
23	600015	华夏银行	886,978	9,863,195.36	0.74
24	600028	中国石化	1,233,471	9,645,743.22	0.72
25	601899	紫金矿业	1,560,490	9,472,174.30	0.71
26	601006	大秦铁路	1,153,255	9,422,093.35	0.70
27	000063	中兴通讯	485,685	9,344,579.40	0.70
28	600104	上海汽车	757,281	9,291,837.87	0.69
29	600019	宝钢股份	1,556,291	9,166,553.99	0.69
30	000983	西山煤电	466,723	8,475,689.68	0.63
31	601988	中国银行	2,482,850	8,416,861.50	0.63
32	600547	山东黄金	210,776	7,672,246.40	0.57
33	000651	格力电器	389,535	7,323,258.00	0.55
34	600048	保利地产	677,743	6,933,310.89	0.52

35	600739	辽宁成大	267,702	6,735,382.32	0.50
36	601186	中国铁建	911,897	6,565,658.40	0.49
37	600383	金地集团	1,059,692	6,421,733.52	0.48
38	000527	美的电器	554,585	6,322,269.00	0.47
39	601390	中国中铁	1,518,959	6,303,679.85	0.47
40	600089	特变电工	425,942	6,244,309.72	0.47
41	002202	金风科技	398,144	6,191,139.20	0.46
42	600256	广汇股份	220,133	6,132,905.38	0.46
43	600489	中金黄金	117,054	6,047,009.64	0.45
44	601919	中国远洋	678,600	5,924,178.00	0.44
45	000568	泸州老窖	206,540	5,828,558.80	0.44
46	601618	中国中冶	1,443,200	5,787,232.00	0.43
47	000338	潍柴动力	93,450	5,747,175.00	0.43
48	601766	中国南车	1,163,130	5,606,286.60	0.42
49	600999	招商证券	264,700	5,436,938.00	0.41
50	000423	东阿阿胶	155,000	5,387,800.00	0.40
51	000792	盐湖钾肥	136,428	5,320,692.00	0.40
52	600795	国电电力	1,622,550	5,305,738.50	0.40
53	600031	三一重工	285,657	5,218,953.39	0.39
54	601600	中国铝业	567,650	5,205,350.50	0.39
55	600111	包钢稀土	143,464	5,094,406.64	0.38
56	600585	海螺水泥	315,932	5,089,664.52	0.38
57	000069	华侨城 A	460,280	5,063,080.00	0.38
58	600011	华能国际	799,816	5,062,835.28	0.38
59	601009	南京银行	495,102	4,970,824.08	0.37
60	601111	中国国航	477,150	4,905,102.00	0.37
61	000402	金融街	588,020	4,892,326.40	0.37
62	600100	同方股份	231,499	4,870,738.96	0.36
63	601168	西部矿业	494,142	4,837,650.18	0.36
64	000895	双汇发展	110,550	4,816,663.50	0.36
65	601299	中国北车	983,500	4,760,140.00	0.36
66	600018	上港集团	1,243,655	4,738,325.55	0.35
67	000709	河北钢铁	1,254,600	4,654,566.00	0.35
68	600348	国阳新能	356,263	4,638,544.26	0.35
69	601898	中煤能源	542,260	4,549,561.40	0.34
70	600690	青岛海尔	237,862	4,543,164.20	0.34
71	000783	长江证券	409,406	4,421,584.80	0.33
72	600518	康美药业	351,349	4,314,565.72	0.32
73	600068	葛洲坝	413,265	4,310,353.95	0.32
74	600875	东方电气	98,560	4,292,288.00	0.32

75	000825	太钢不锈	843,700	4,285,996.00	0.32
76	601699	潞安环能	136,375	4,265,810.00	0.32
77	000060	中金岭南	329,035	4,257,712.90	0.32
78	600655	豫园商城	189,187	4,184,816.44	0.31
79	600664	哈药股份	220,743	4,081,538.07	0.31
80	002142	宁波银行	370,250	4,080,155.00	0.30
81	000538	云南白药	63,250	4,079,625.00	0.30
82	600005	武钢股份	928,741	3,984,298.89	0.30
83	600415	小商品城	201,581	3,942,924.36	0.29
84	000425	徐工机械	128,450	3,934,423.50	0.29
85	000898	鞍钢股份	546,483	3,923,747.94	0.29
86	601788	光大证券	254,700	3,894,363.00	0.29
87	601607	上海医药	236,100	3,867,318.00	0.29
88	002007	华兰生物	85,380	3,848,930.40	0.29
89	600832	东方明珠	471,986	3,808,927.02	0.28
90	000157	中联重科	233,510	3,794,537.50	0.28
91	600660	福耀玻璃	415,346	3,696,579.40	0.28
92	601998	中信银行	681,942	3,682,486.80	0.28
93	600694	大商股份	87,012	3,681,477.72	0.28
94	000800	一汽轿车	241,100	3,664,720.00	0.27
95	000623	吉林敖东	135,861	3,608,468.16	0.27
96	000768	西飞国际	366,990	3,596,502.00	0.27
97	600309	烟台万华	246,333	3,593,998.47	0.27
98	000729	燕京啤酒	179,250	3,549,150.00	0.27
99	601666	平煤股份	268,999	3,515,816.93	0.26
100	600362	江西铜业	145,323	3,496,471.38	0.26
101	601958	金钼股份	286,750	3,489,747.50	0.26
102	600881	亚泰集团	561,272	3,434,984.64	0.26
103	600600	青岛啤酒	103,110	3,404,692.20	0.25
104	600177	雅戈尔	329,798	3,396,919.40	0.25
105	600009	上海机场	285,450	3,394,000.50	0.25
106	000878	云南铜业	186,100	3,331,190.00	0.25
107	600642	申能股份	427,991	3,295,530.70	0.25
108	600196	复星医药	188,075	3,291,312.50	0.25
109	600166	福田汽车	190,014	3,266,340.66	0.24
110	600550	天威保变	172,991	3,262,610.26	0.24
111	600320	振华重工	523,141	3,196,391.51	0.24
112	600029	南方航空	503,700	3,163,236.00	0.24
113	000933	神火股份	186,610	3,118,253.10	0.23
114	600132	重庆啤酒	85,976	3,095,136.00	0.23

115	000839	中信国安	278,650	3,070,723.00	0.23
116	000039	中集集团	255,450	3,039,855.00	0.23
117	000024	招商地产	204,050	3,036,264.00	0.23
118	600649	城投控股	349,350	2,993,929.50	0.22
119	601333	广深铁路	837,170	2,955,210.10	0.22
120	000728	国元证券	238,920	2,902,878.00	0.22
121	600188	兖州煤业	175,330	2,878,918.60	0.22
122	600583	海油工程	576,121	2,857,560.16	0.21
123	000009	中国宝安	331,695	2,852,577.00	0.21
124	600125	铁龙物流	208,198	2,812,754.98	0.21
125	000630	铜陵有色	191,700	2,781,567.00	0.21
126	601001	大同煤业	99,160	2,774,496.80	0.21
127	600352	浙江龙盛	304,519	2,771,122.90	0.21
128	000401	冀东水泥	179,593	2,677,731.63	0.20
129	000999	华润三九	115,950	2,661,052.50	0.20
130	600062	双鹤药业	101,610	2,637,795.60	0.20
131	000100	TCL 集团	696,050	2,610,187.50	0.20
132	600037	歌华有线	188,475	2,608,494.00	0.19
133	000562	宏源证券	177,750	2,604,037.50	0.19
134	000969	安泰科技	177,240	2,601,883.20	0.19
135	600123	兰花科创	101,510	2,595,610.70	0.19
136	600631	百联股份	195,692	2,573,349.80	0.19
137	000061	农产品	159,320	2,530,001.60	0.19
138	600153	建发股份	220,939	2,503,238.87	0.19
139	000528	柳 工	134,810	2,484,548.30	0.19
140	600741	华域汽车	306,042	2,466,698.52	0.18
141	600601	方正科技	511,456	2,439,645.12	0.18
142	600598	北大荒	210,626	2,399,030.14	0.18
143	600997	开滦股份	182,880	2,384,755.20	0.18
144	601866	中海集运	704,952	2,375,688.24	0.18
145	600497	驰宏锌锗	149,241	2,358,007.80	0.18
146	600635	大众公用	354,349	2,345,790.38	0.18
147	600811	东方集团	405,470	2,315,233.70	0.17
148	600812	华北制药	243,740	2,298,468.20	0.17
149	000937	冀中能源	102,750	2,286,187.50	0.17
150	600010	包钢股份	761,139	2,275,805.61	0.17
151	600808	马钢股份	707,180	2,241,760.60	0.17
152	600219	南山铝业	286,446	2,222,820.96	0.17
153	600688	S 上石化	288,496	2,204,109.44	0.16
154	600839	四川长虹	590,395	2,178,557.55	0.16

155	600150	中国船舶	39,234	2,173,955.94	0.16
156	000652	泰达股份	305,950	2,172,245.00	0.16
157	600208	新湖中宝	451,170	2,152,080.90	0.16
158	000012	南玻A	233,885	2,140,047.75	0.16
159	600675	中华企业	296,425	2,128,331.50	0.16
160	000778	新兴铸管	340,734	2,126,180.16	0.16
161	600588	用友软件	96,671	2,111,294.64	0.16
162	600432	吉恩镍业	113,105	2,081,132.00	0.16
163	000021	长城开发	195,400	2,069,286.00	0.15
164	600717	天津港	248,060	2,058,898.00	0.15
165	600216	浙江医药	80,009	2,054,631.12	0.15
166	000422	湖北宜化	160,650	2,046,681.00	0.15
167	600271	航天信息	136,756	2,034,929.28	0.15
168	600663	陆家嘴	120,722	2,028,129.60	0.15
169	600895	张江高科	229,392	1,984,240.80	0.15
170	002028	思源电气	78,100	1,983,740.00	0.15
171	600325	华发股份	193,632	1,980,855.36	0.15
172	600312	平高电气	194,060	1,973,590.20	0.15
173	000680	山推股份	179,900	1,973,503.00	0.15
174	600269	赣粤高速	345,882	1,968,068.58	0.15
175	002304	洋河股份	13,300	1,953,770.00	0.15
176	600595	中孚实业	175,270	1,952,507.80	0.15
177	601808	中海油服	175,402	1,939,946.12	0.15
178	600879	航天电子	192,192	1,921,920.00	0.14
179	600517	置信电气	109,977	1,903,701.87	0.14
180	600500	中化国际	212,925	1,899,291.00	0.14
181	600331	宏达股份	183,447	1,895,007.51	0.14
182	600220	江苏阳光	369,833	1,867,656.65	0.14
183	600779	水井坊	101,352	1,866,903.84	0.14
184	000027	深圳能源	195,750	1,863,540.00	0.14
185	000031	中粮地产	268,600	1,847,968.00	0.14
186	600221	海南航空	350,232	1,842,220.32	0.14
187	600643	爱建股份	242,983	1,824,802.33	0.14
188	000725	京东方A	637,000	1,821,820.00	0.14
189	000690	宝新能源	358,075	1,804,698.00	0.13
190	600108	亚盛集团	411,607	1,794,606.52	0.13
191	600058	五矿发展	127,048	1,787,565.36	0.13
192	000960	锡业股份	118,760	1,782,587.60	0.13
193	600008	首创股份	325,850	1,782,399.50	0.13
194	000625	长安汽车	204,950	1,781,015.50	0.13

195	600210	紫江企业	340,515	1,774,083.15	0.13
196	600395	盘江股份	98,021	1,764,378.00	0.13
197	000686	东北证券	75,760	1,756,874.40	0.13
198	600528	中铁二局	216,143	1,750,758.30	0.13
199	600085	同仁堂	77,109	1,746,518.85	0.13
200	000718	苏宁环球	201,720	1,742,860.80	0.13
201	601588	北辰实业	472,760	1,735,029.20	0.13
202	600316	洪都航空	52,241	1,728,132.28	0.13
203	000488	晨鸣纸业	263,800	1,704,148.00	0.13
204	600161	天坛生物	72,342	1,689,909.12	0.13
205	000612	焦作万方	99,550	1,683,390.50	0.13
206	601179	中国西电	258,100	1,675,069.00	0.13
207	002155	辰州矿业	97,300	1,674,533.00	0.13
208	601918	国投新集	164,400	1,671,948.00	0.12
209	000667	名流置业	530,725	1,671,783.75	0.12
210	601872	招商轮船	406,880	1,651,932.80	0.12
211	600118	中国卫星	104,390	1,633,703.50	0.12
212	600970	中材国际	89,920	1,618,560.00	0.12
213	600066	宇通客车	107,759	1,606,686.69	0.12
214	600033	福建高速	406,468	1,581,160.52	0.12
215	600809	山西汾酒	38,500	1,579,655.00	0.12
216	600143	金发科技	206,848	1,553,428.48	0.12
217	000897	津滨发展	383,250	1,540,665.00	0.12
218	600026	中海发展	187,425	1,536,885.00	0.11
219	600718	东软集团	83,870	1,514,692.20	0.11
220	600418	江淮汽车	229,099	1,512,053.40	0.11
221	601888	中国国旅	78,200	1,497,530.00	0.11
222	000951	中国重汽	87,000	1,487,700.00	0.11
223	600549	厦门钨业	80,859	1,471,633.80	0.11
224	601727	上海电气	215,700	1,471,074.00	0.11
225	002001	新和成	57,345	1,470,899.25	0.11
226	601991	大唐发电	209,880	1,446,073.20	0.11
227	600508	上海能源	85,676	1,445,354.12	0.11
228	600804	鹏博士	158,580	1,414,533.60	0.11
229	600300	维维股份	247,700	1,401,982.00	0.10
230	600096	云天化	87,426	1,399,690.26	0.10
231	600169	太原重工	127,080	1,399,150.80	0.10
232	600737	中粮屯河	148,932	1,398,471.48	0.10
233	600428	中远航运	194,114	1,393,738.52	0.10
234	600596	新安股份	140,865	1,391,746.20	0.10

235	000900	现代投资	82,800	1,387,728.00	0.10
236	600087	长航油运	286,296	1,379,946.72	0.10
237	600369	西南证券	112,805	1,375,092.95	0.10
238	000059	辽通化工	177,849	1,374,772.77	0.10
239	000807	云铝股份	175,350	1,372,990.50	0.10
240	600183	生益科技	170,063	1,353,701.48	0.10
241	600611	大众交通	185,247	1,348,598.16	0.10
242	000758	中色股份	113,560	1,346,821.60	0.10
243	002128	露天煤业	78,564	1,337,944.92	0.10
244	600022	济南钢铁	369,743	1,331,074.80	0.10
245	600674	川投能源	110,505	1,326,060.00	0.10
246	600816	安信信托	96,050	1,306,280.00	0.10
247	002122	天马股份	140,798	1,275,629.88	0.10
248	600820	隧道股份	152,150	1,275,017.00	0.10
249	600170	上海建工	126,700	1,268,267.00	0.09
250	000932	华菱钢铁	333,000	1,255,410.00	0.09
251	600886	国投电力	177,260	1,251,455.60	0.09
252	601107	四川成渝	192,200	1,239,690.00	0.09
253	000717	韶钢松山	346,200	1,235,934.00	0.09
254	600266	北京城建	109,747	1,234,653.75	0.09
255	600456	宝钛股份	63,725	1,222,882.75	0.09
256	600516	方大炭素	189,475	1,222,113.75	0.09
257	600426	华鲁恒升	102,810	1,208,017.50	0.09
258	600004	白云机场	136,306	1,203,581.98	0.09
259	600239	云南城投	75,042	1,199,171.16	0.09
260	600027	华电国际	316,364	1,199,019.56	0.09
261	600863	内蒙华电	176,100	1,183,392.00	0.09
262	600109	国金证券	88,888	1,179,543.76	0.09
263	600236	桂冠电力	270,224	1,164,665.44	0.09
264	601117	中国化学	292,300	1,145,816.00	0.09
265	600380	健康元	156,119	1,131,862.75	0.08
266	600835	上海机电	119,470	1,115,849.80	0.08
267	000959	首钢股份	351,500	1,096,680.00	0.08
268	000927	一汽夏利	141,800	1,096,114.00	0.08
269	000046	泛海建设	135,000	1,081,350.00	0.08
270	600006	东风汽车	237,016	1,054,721.20	0.08
271	000089	深圳机场	200,250	1,053,315.00	0.08
272	000968	煤气化	76,049	1,034,266.40	0.08
273	000780	平庄能源	120,200	1,009,680.00	0.08
274	600569	安阳钢铁	283,668	1,001,348.04	0.07

275	002244	滨江集团	120,129	980,252.64	0.07
276	600307	酒钢宏兴	121,161	972,922.83	0.07
277	601099	太平洋	89,112	971,320.80	0.07
278	600017	日照港	178,900	955,326.00	0.07
279	000876	新希望	112,050	954,666.00	0.07
280	600748	上实发展	128,390	950,086.00	0.07
281	600246	万通地产	180,254	937,320.80	0.07
282	000961	中南建设	103,800	913,440.00	0.07
283	600350	山东高速	199,295	908,785.20	0.07
284	600597	光明乳业	123,461	908,672.96	0.07
285	600376	首开股份	68,103	893,511.36	0.07
286	600685	广船国际	49,941	870,971.04	0.07
287	600657	信达地产	135,478	864,349.64	0.06
288	000685	中山公用	53,275	820,435.00	0.06
289	600251	XD 冠农股	53,608	812,697.28	0.06
290	600151	航天机电	88,654	792,566.76	0.06
291	002242	九阳股份	67,650	777,298.50	0.06
292	601139	深圳燃气	72,900	745,767.00	0.06
293	600282	南钢股份	199,631	688,726.95	0.05
294	600102	莱钢股份	82,009	680,674.70	0.05
295	601003	柳钢股份	151,800	636,042.00	0.05
296	000631	顺发恒业	92,900	569,477.00	0.04
297	601877	正泰电器	24,900	441,975.00	0.03
298	601801	皖新传媒	26,100	283,446.00	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	601328	交通银行	16,693,721.91	0.78
2	601939	建设银行	15,849,670.40	0.74
3	600036	招商银行	15,713,040.93	0.73
4	601166	兴业银行	10,779,263.76	0.50
5	601318	中国平安	9,009,094.14	0.42
6	600016	民生银行	8,644,140.90	0.40
7	601668	中国建筑	7,522,904.71	0.35
8	000709	河北钢铁	7,004,615.00	0.33
9	600000	浦发银行	6,777,424.17	0.31
10	600030	中信证券	6,056,081.90	0.28
11	601088	中国神华	5,992,535.87	0.28
12	000063	中兴通讯	5,504,495.22	0.26
13	600999	招商证券	5,394,335.44	0.25
14	000002	万科 A	5,343,652.53	0.25
15	601601	中国太保	4,797,691.45	0.22
16	601299	中国北车	4,755,285.02	0.22
17	600104	上海汽车	4,524,748.41	0.21
18	601169	北京银行	4,180,781.60	0.19
19	601988	中国银行	4,110,434.50	0.19
20	600837	海通证券	3,884,094.66	0.18

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	21,429,647.03	1.00
2	601328	交通银行	20,404,126.52	0.95
3	601988	中国银行	18,572,308.10	0.86
4	601318	中国平安	16,178,822.03	0.75
5	600016	民生银行	16,031,029.75	0.74
6	600000	浦发银行	13,204,614.46	0.61
7	601166	兴业银行	12,977,073.91	0.60
8	600030	中信证券	12,257,165.73	0.57
9	601088	中国神华	10,966,771.01	0.51
10	601939	建设银行	10,875,059.89	0.51
11	000002	万科 A	9,677,000.15	0.45
12	601601	中国太保	9,464,162.89	0.44
13	601169	北京银行	7,548,277.28	0.35
14	600900	长江电力	7,158,028.73	0.33
15	000001	深发展 A	7,076,762.69	0.33
16	600837	海通证券	6,944,153.81	0.32
17	600519	贵州茅台	6,519,303.12	0.30
18	000858	五粮液	6,291,495.31	0.29
19	600276	恒瑞医药	6,284,900.13	0.29
20	600050	中国联通	6,257,532.26	0.29

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	406,029,538.56
卖出股票收入（成交）总额	649,972,755.10

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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投资。

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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	408,026.19
2	应收证券清算款	8,368,560.94
3	应收股利	624,686.30
4	应收利息	12,901.91
5	应收申购款	3,200,302.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,614,477.72

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	40,877,721.89	3.06	重大事项公告

§ 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
60,647	22,945.25	207,509,492.75	14.91%	1,184,051,281.97	85.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	7,170,939.95	0.5153%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月25日）基金份额总额	1,580,754,997.47
本报告期期初基金份额总额	1,625,937,096.08
本报告期基金总申购份额	413,183,671.23
减：本报告期基金总赎回份额	647,559,992.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,391,560,774.72

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2009年6月18日，我公司收到中国国际经济贸易仲裁委员会发来的《南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同争议案件仲裁通知》，南方稳健成长贰号证券投资基金的基金份额持有人袁近秋就该基金2007年度的基金分红问题，对我公司提出了仲裁申请，要求本公司赔偿其红利损失及相应利息共计66586.52元，退还管理费2041.49元，争议标的总额为人民币68628.01元。

2010年3月26日，我公司收到中国国际经济贸易仲裁委员会发来的【2010】中国贸仲京裁字第0152号《裁决书》，驳回申请人袁近秋的赔偿请求，具体裁决如下：

（一）被申请人应向南方稳健成长贰号证券投资基金退还管理费计人民币 702.71 元。

（二）本案仲裁费为人民币5011元，由申请人承担人民币1002.20元，由被申请人承担人民币4008.80元。

（三）驳回申请人的其他仲裁请求。

上述（一）、（二）项下的内容被申请人应于本裁决作出之日起20日内履行完毕。

本裁决为终局裁决，自作出之日起生效。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
国信证券	2	488,711,565.65	46.35%	409,388.65	46.20%	
光大证券	1	131,735,969.15	12.50%	111,926.02	12.63%	
长江证券	1	123,887,051.15	11.75%	105,305.77	11.88%	
广发证券	1	104,343,093.00	9.90%	84,779.94	9.57%	
中银证券	1	84,067,655.91	7.97%	71,459.98	8.06%	
方正证券	1	68,590,177.39	6.51%	58,302.31	6.58%	
申银万国	2	23,526,884.47	2.23%	19,998.28	2.26%	
平安证券	2	22,518,106.56	2.14%	19,140.90	2.16%	
华泰证券	1	6,902,803.49	0.65%	5,867.66	0.66%	
中投证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
湘财证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
浙商证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	
中信建投	0	-	-	-	-	退租上海交易单元一个 退租深圳交易单元一个
中金证券	0	-	-	-	-	退租上海交易单元一个
银河证券	0	-	-	-	-	退租上海交易单元一个

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券	5,517,512.00	52.32%	50,000,000.00	100.00%
光大证券	5,027,522.50	47.68%	-	-

注：交易单元的选择标准和程序。

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）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-30
2	关于旗下部分开放式基金变更基金份额净值计算位数的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-30
3	关于开通交通银行卡网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-10
4	关于开通工商银行卡网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-10
5	关于旗下部分基金在信达证券推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-9
6	关于旗下部分基金在申银万国推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-7
7	关于旗下部分基金参加中信银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-1
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-21
9	关于增加江苏张家港农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-20
10	南方基金关于旗下部分基金在中投证券开展转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-12
11	关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-8
12	关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-6
13	南方基金关于旗下基金在部分代销机构推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-6
14	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构及开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-6
15	南方基金关于旗下基金参与深圳发展银行开展的基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-4
16	关于公司旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-27
17	关于调整网上直销交易定投申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-20
18	关于基金对账单邮寄服务规则调整的说明	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-14
19	关于旗下部分基金参加青岛银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-9
20	关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-9

21	关于旗下部分开放式证券投资基金增加中信银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-1
22	关于旗下部分基金参加华夏银行延长网银及基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-1
23	关于旗下部分基金参加上海银行个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-1
24	关于旗下基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-1
25	关于旗下部分开放式证券投资基金增加浙商银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-10
26	南方基金管理有限公司北京分公司搬迁公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-9
27	南方基金关于暂停部分基金在深交所净值揭示的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-2-26
28	南方基金关于网上交易开通定期不定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-2-9
29	南方基金关于网上交易开通定期定额转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-2-9
30	南方基金关于网上交易开通兴业银行卡定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-2-9
31	关于旗下部分开放式证券投资基金增加华融证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-25
32	关于旗下部分基金参加上海农商银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-18
33	关于旗下基金参与深圳发展银行开展的基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-18

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方沪深 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同。
- 3、南方沪深 300 指数证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>