
华夏沪深 300 指数证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

§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 2011 年 8 月 19 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。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	8
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	10
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	11
6.4 报表附注.....	12
§7 投资组合报告.....	24
7.1 期末基金资产组合情况.....	24
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	24
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.....	25
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	33
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.....	33
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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
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.....	34
§9 开放式基金份额变动.....	34
§10 重大事件揭示.....	34
§11 备查文件目录.....	36

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深300指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深300指数
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	25,115,986,438.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时应按期间折算）。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	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 33 号通泰大厦 B 座 3 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		范勇宏	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	www.ChinaAMC.com

人互联网网址	
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	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-222,287,005.80
本期利润	-344,545,079.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0137
本期加权平均净值利润率	-1.55%
本期基金份额净值增长率	-1.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-3,376,166,029.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1344
期末基金资产净值	21,739,820,408.51
期末基金份额净值	0.866
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-13.40%

注：①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。

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期末可供分配利润为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。

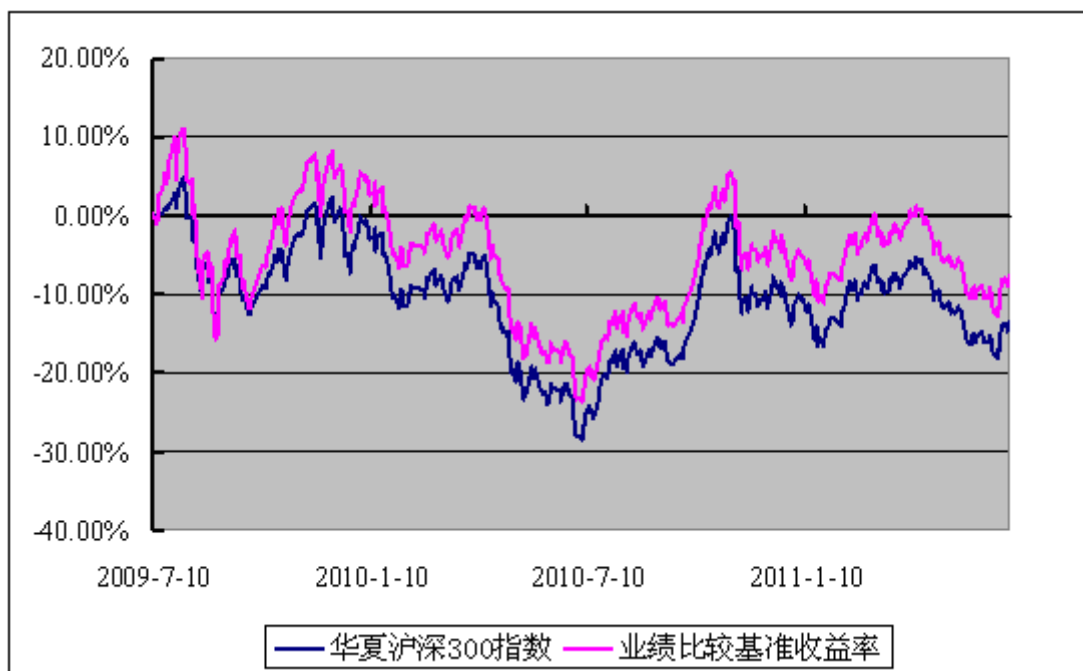
3.2 基金净值表现

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	2.00%	1.13%	1.43%	1.13%	0.57%	0.00%
过去三个月	-4.52%	1.04%	-5.03%	1.04%	0.51%	0.00%
过去六个月	-1.93%	1.17%	-2.06%	1.17%	0.13%	0.00%
过去一年	19.12%	1.33%	18.83%	1.33%	0.29%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.40%	1.45%	-7.88%	1.59%	-5.52%	-0.14%

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

华夏沪深 300 指数证券投资基金
 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
 (2009 年 7 月 10 日至 2011 年 6 月 30 日)



§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州和广州设有分公司，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2011 年上半年，在市场震荡的情况下，华夏基金加强风险控制，坚持稳健的投资风格，努力把握投资机会。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2011 年 6 月 30 日数据），华夏收入股票在 217 只标准股票型基金中排名第 10；华夏大盘精选混合、华夏红利混合在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中分别排名第 2 和第 7；华夏策略混合在 48 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 1。

2011 年 3 月，在《证券时报》举办的“第七届中国基金业明星奖颁奖仪式

暨中国明星基金论坛”中，华夏基金获得“长期回报明星基金公司奖”；2011年4月，在《上海证券报》主办的中国“金基金”奖颁奖典礼中，华夏基金第六次荣获“金基金 TOP 公司奖”；在《中国证券报》、中央电视台主办的“中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金第六次荣获年度“金牛基金管理公司奖”。

上半年，为更好地满足客户需求，华夏基金恢复办理原中信四只基金的转换业务；并调整了在本公司进行登记结算的基金的分红方式变更规则，从而使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金分别设置分红方式。

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		
张弘弢	本基金的基金经理	2009-07-10	-	11 年	硕士。2000 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究发展部总经理、金融工程部副总经理。
方军	本基金的基金经理	2009-07-10	-	12 年	硕士。1999 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内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

2011 年上半年，国际方面，主要发达国家复苏进程缓慢，欧洲债务危机不断升级，中东及北非局势反复动荡。国内方面，经济整体运行平稳，但增速有所放缓，通货膨胀压力居高不下，6 月份 CPI 达到 6.4%，创下 3 年以来的新高。政府将控制通胀放在更加重要的位置，持续推出利率、存款准备金率、汇率、公开市场操作等多项政策组合回收流动性，受此影响，实体经济流动性明显收紧，民间借贷利率显著上行。市场方面，A 股市场呈现震荡整理走势，沪深 300 指数上半年下跌了 2.69%。从沪深 300 指数结构看，银行、地产、煤炭、钢铁、建材等低估值行业显著优于医药、电子元器件等高估值行业。

另外一个值得注意的现象是成份股调整效应日益明显。近年来随着指数基金产品的数量和规模增长，成份股调整对市场的影响不断增加，部分投资者也开始主动利用这种影响进行相关投资操作，这在客观上提高了指数基金进行成份股调整的难度，加大了期间相关股票的波动。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，积极研究并应对成份股调整，努力为投资者实现较好的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.866 元，本报告期份额净值增长率为-1.93%，同期业绩比较基准增长率为-2.06%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为通货膨胀压力依然较大，宏观政策仍会偏紧，但通货膨胀可能会出现阶段性高点，加之经济增速可能持续放缓，政府的宏观政策可能会出现放松迹象。此外，境外国家、地区尤其是美国的经济及其政策走向、欧洲债务危机等因素也会成为国内宏观政策的重要考量因素。如果未来宏观政策出现松动，沪深 300 指数可能会有阶段性的机会，反之，则会继续保持震荡整理的走

势。

本基金将会根据基金合同及相关法律法规要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好成份股调整工作，并力争和业绩基准保持一致。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

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及基金合同约定，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、投资风险负责人、法律监察负责人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定的相关制度，估值工作决策机构的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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

2011 年上半年，本基金托管人在对华夏沪深 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

2011 年上半年，华夏沪深 300 指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 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，华夏沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 指数证券投资基金 2011 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。

§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：华夏沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	318,981,407.95	111,629,073.46
结算备付金		6,098,624.17	10,940,031.22
存出保证金		1,514,503.40	1,128,134.11
交易性金融资产	6.4.7.2	21,523,261,740.17	22,542,446,098.50
其中：股票投资		20,647,202,864.37	21,394,793,947.60
基金投资		-	-
债券投资		876,058,875.80	1,147,652,150.90
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		-	91,110,061.56
应收利息	6.4.7.5	9,225,584.10	15,548,483.34
应收股利		23,775,856.84	-
应收申购款		5,949,228.91	31,312,640.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,888,806,945.54	22,804,114,523.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		30,000,000.00	-
应付证券清算款		41,623,569.14	-
应付赎回款		19,628,712.59	15,285,995.87

应付管理人报酬		8,624,285.54	9,776,706.30
应付托管费		1,724,857.10	1,955,341.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	46,417,777.11	46,147,094.81
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	967,335.55	898,806.56
负债合计		148,986,537.03	74,063,944.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,115,986,438.07	25,736,288,433.15
未分配利润	6.4.7.10	-3,376,166,029.56	-3,006,237,854.78
所有者权益合计		21,739,820,408.51	22,730,050,578.37
负债和所有者权益总计		21,888,806,945.54	22,804,114,523.15

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.866 元，基金份额总额 25,115,986,438.07 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-272,503,374.18	-7,311,399,368.46
1.利息收入		13,537,198.91	10,229,762.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,130,526.20	1,462,259.02
债券利息收入		12,406,672.71	8,734,167.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	33,335.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-165,905,557.98	183,121,412.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-334,794,434.20	60,326,936.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,478,999.50	-195,582.50
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	176,367,875.72	122,990,058.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-122,258,073.73	-7,508,746,544.75
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	2,123,058.62	3,996,001.42
减：二、费用		72,041,705.35	84,186,049.24
1.管理人报酬		55,148,365.06	59,991,134.80
2.托管费		11,029,673.04	11,998,226.91

3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	5,206,570.68	10,317,646.83
5.利息支出		452,767.21	1,679,726.04
其中：卖出回购金融资产支出		452,767.21	1,679,726.04
6.其他费用	6.4.7.19	204,329.36	199,314.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-344,545,079.53	-7,395,585,417.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-344,545,079.53	-7,395,585,417.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	25,736,288,433.15	-3,006,237,854.78	22,730,050,578.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-344,545,079.53	-344,545,079.53
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）	-620,301,995.08	-25,383,095.25	-645,685,090.33
其中：1.基金申购款	3,427,809,839.34	-404,502,519.11	3,023,307,320.23
2.基金赎回款	-4,048,111,834.42	379,119,423.86	-3,668,992,410.56
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）	25,115,986,438.07	-3,376,166,029.56	21,739,820,408.51
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,241,515,057.61	-62,376,950.67	26,179,138,106.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,395,585,417.70	-7,395,585,417.70
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）	2,305,233,196.56	-330,743,515.38	1,974,489,681.18
其中：1.基金申购款	5,841,244,236.05	-670,139,571.69	5,171,104,664.36
2.基金赎回款	-3,536,011,039.49	339,396,056.31	-3,196,614,983.18
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）	28,546,748,254.17	-7,788,705,883.75	20,758,042,370.42

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：

<u>范勇宏</u>	<u>崔雁巍</u>	<u>崔雁巍</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 指数证券投资基金(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[2009]531 号《关于核准华夏沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准,由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金自 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 8 日期间共募集 24,771,692,420.44 元(不含认购资金利息),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 718 号予以验证。经向中国证监会备案,《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 24,771,957,170.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 264,749.65 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股、新股、固定收益产品、权证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。

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”)、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《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》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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年

6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[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、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。其中，对基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。
- 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。
- 5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	318,981,407.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	318,981,407.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,525,245,076.27	20,647,202,864.37	-1,878,042,211.90
债券	交易所市场	277,683,972.10	277,265,875.80
	银行间市场	599,175,060.00	598,793,000.00
	合计	876,859,032.10	876,058,875.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,402,104,108.37	21,523,261,740.17	-1,878,842,368.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	54,610.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,744.40
应收债券利息	9,168,228.93
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-

合计	9,225,584.10
----	--------------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	46,417,027.11
银行间市场应付交易费用	750.00
合计	46,417,777.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	34,315.25
预提费用	183,020.30
合计	967,335.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,736,288,433.15	25,736,288,433.15
本期申购	3,427,809,839.34	3,427,809,839.34
本期赎回（以“-”号填列）	-4,048,111,834.42	-4,048,111,834.42
本期末	25,115,986,438.07	25,115,986,438.07

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-817,146,040.58	-2,189,091,814.20	-3,006,237,854.78
本期利润	-222,287,005.80	-122,258,073.73	-344,545,079.53
本期基金份额交易产生的变动数	21,857,353.78	-47,240,449.03	-25,383,095.25
其中：基金申购款	-123,257,869.51	-281,244,649.60	-404,502,519.11
基金赎回款	145,115,223.29	234,004,200.57	379,119,423.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,017,575,692.60	-2,358,590,336.96	-3,376,166,029.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,071,428.55
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	53,089.91
其他	6,007.74
合计	1,130,526.20

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,586,225,458.59
减：卖出股票成本总额	3,921,019,892.79
买卖股票差价收入	-334,794,434.20

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,264,259,451.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,245,201,615.35
减：应收利息总额	26,536,836.07
债券投资收益	-7,478,999.50

6.4.7.14 衍生工具收益

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 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	176,367,875.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	176,367,875.72

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-122,258,073.73
——股票投资	-119,279,749.13
——债券投资	-2,978,324.60
——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	-122,258,073.73

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	2,123,058.62
合计	2,123,058.62

注：本基金赎回时份额持有不满 1 年的，收取 0.5%的赎回费，持有满 1 年以上（含 1 年）的，赎回费为 0。其中，赎回费总额的 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 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	5,198,670.68
银行间市场交易费用	7,900.00
合计	5,206,570.68

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	119,012.93
银行费用	16,809.06
银行间账户维护费	9,000.00
合计	204,329.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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、基金销售机构

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信证券	-	-	1,362,724,362.89	18.74%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 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
中信证券	-	-	150,000,000.00	7.66%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	-	-	1,337,080.04	2.88%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	1,158,314.03	18.93%	1,158,314.03	2.62%

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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,148,365.06	59,991,134.80
其中：支付销售机构的客户维护费	14,513,028.96	15,649,627.32

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.5% / 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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,029,673.04	11,998,226.91

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 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

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	545,200,000.00	193,919.13

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期初持有的基金份额	-	-	82,190,022.96
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	-	-	82,190,022.96	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.29%	-

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	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	318,981,407.95	1,071,428.55	277,785,351.95	1,388,234.33

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股/张)	总金额
中信证券	601166	兴业银行	配股发行	3,407,646	61,337,628.00
中信证券	600036	招商银行	配股发行	6,370,000	56,374,500.00

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601798	蓝科高新	2011-06-14	2011-09-22	新发流通受限	11.00	13.27	264,845	2,913,295.00	3,514,493.15	-

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
000652	泰达股份	2010-11-22	筹划重大事项	7.68	2011-07-08	7.68	4,233,000	34,269,568.60	32,509,440.00	-
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票融资事宜	31.39	2011-07-04	32.60	1,029,000	31,998,007.23	32,300,310.00	-
000876	新希望	2011-06-29	证监会并购重组委审核公司重大资产重组事宜	19.95	2011-07-05	21.95	1,557,000	18,271,079.07	31,062,150.00	-
600369	西南证券	2011-03-01	筹划重大重组事项	11.87	2011-08-16	12.49	2,190,000	28,708,124.93	25,995,300.00	-
600170	上海建工	2011-06-29	证监会并购重组委审核公司资产重组事宜	15.59	2011-07-04	16.25	1,550,000	23,152,606.34	24,164,500.00	-
000959	首钢股份	2010-10-29	筹划重大资产重组事项	4.42	-	-	5,200,000	31,302,221.33	22,984,000.00	-

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

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,000,000.00 元，于 2011 年 7 月 1 日到期。该类交

易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后,通过正式报告的方式,将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会,协助制定风险控制决策,实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法,估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重性;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的金融工具特征,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,及时对各种风险进行监督、检查和评估,并制定相应决策,将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息,债券发行人信用评级降低导致债券价格下降,或基金在交易过程中发生交收违约,而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库,对发行人及债券投资进行内部评级,对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度,以控制可能的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合,从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易,除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外,其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合 Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

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 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	20,647,202,864.37	94.97	21,394,793,947.60	94.13
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	20,647,202,864.37	94.97	21,394,793,947.60	94.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于100个交易日的资产，默认其波动与市场同步。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	+5%	1,033,392,503.36	1,076,799,979.38
-5%	-1,033,392,503.36	-1,076,799,979.38	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,647,202,864.37	94.33
	其中：股票	20,647,202,864.37	94.33
2	固定收益投资	876,058,875.80	4.00
	其中：债券	876,058,875.80	4.00
	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	325,080,032.12	1.49
6	其他各项资产	40,465,173.25	0.18
7	合计	21,888,806,945.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	117,748,550.70	0.54
B	采掘业	2,419,619,467.32	11.13
C	制造业	7,772,559,803.39	35.75
C0	食品、饮料	1,232,938,185.31	5.67
C1	纺织、服装、皮毛	72,786,000.00	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	525,771,944.05	2.42
C5	电子	222,804,500.00	1.02
C6	金属、非金属	1,942,694,100.66	8.94
C7	机械、设备、仪表	2,868,293,100.45	13.19
C8	医药、生物制品	864,626,072.92	3.98
C99	其他制造业	42,645,900.00	0.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	455,993,680.91	2.10
E	建筑业	655,494,359.42	3.02
F	交通运输、仓储业	784,282,883.54	3.61

G	信息技术业	666,097,585.55	3.06
H	批发和零售贸易	636,410,288.26	2.93
I	金融、保险业	5,462,237,102.65	25.13
J	房地产业	1,027,957,402.92	4.73
K	社会服务业	183,766,094.00	0.85
L	传播与文化产业	45,460,974.71	0.21
M	综合类	419,574,671.00	1.93
	合计	20,647,202,864.37	94.97

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	45,100,000	587,202,000.00	2.70
2	601318	中国平安	11,900,000	574,413,000.00	2.64
3	600837	海通证券	56,599,958	510,531,621.16	2.35
4	600016	民生银行	89,000,000	509,970,000.00	2.35
5	601328	交通银行	89,000,000	493,060,000.00	2.27
6	600000	浦发银行	41,419,017	407,563,127.28	1.87
7	601166	兴业银行	28,350,928	382,170,509.44	1.76
8	601088	中国神华	11,600,000	349,624,000.00	1.61
9	601939	建设银行	63,900,000	315,666,000.00	1.45
10	000002	万科A	35,100,000	296,595,000.00	1.36
11	600519	贵州茅台	1,346,000	286,199,980.00	1.32
12	601601	中国太保	11,300,000	253,007,000.00	1.16
13	000858	五粮液	6,990,000	249,682,800.00	1.15
14	600585	海螺水泥	8,605,232	238,881,240.32	1.10
15	600031	三一重工	11,190,000	201,867,600.00	0.93
16	002024	苏宁电器	15,140,000	193,943,400.00	0.89
17	600111	包钢稀土	2,650,000	189,289,500.00	0.87
18	601668	中国建筑	46,800,000	188,604,000.00	0.87
19	601006	大秦铁路	21,350,000	174,856,500.00	0.80
20	601169	北京银行	17,347,811	172,957,675.67	0.80
21	000001	深发展A	10,000,000	170,700,000.00	0.79
22	000651	格力电器	7,200,000	169,200,000.00	0.78
23	600050	中国联通	31,940,000	167,685,000.00	0.77
24	000063	中兴通讯	5,300,000	149,884,000.00	0.69
25	601857	中国石油	13,630,000	148,430,700.00	0.68
26	000157	中联重科	9,591,462	147,516,685.56	0.68
27	601989	中国重工	10,600,087	146,175,199.73	0.67
28	600048	保利地产	13,000,000	142,870,000.00	0.66
29	000983	西山煤电	5,830,000	141,086,000.00	0.65
30	601899	紫金矿业	19,295,000	139,695,800.00	0.64
31	000792	盐湖股份	2,279,999	134,519,941.00	0.62
32	000527	美的电器	7,310,000	134,430,900.00	0.62
33	600481	双良节能	9,032,252	130,606,363.92	0.60
34	600900	长江电力	17,500,000	126,175,000.00	0.58
35	600104	上海汽车	6,688,000	125,333,120.00	0.58
36	600028	中国石化	15,225,000	125,301,750.00	0.58

37	600089	特变电工	9,529,000	123,305,260.00	0.57
38	600547	山东黄金	2,690,000	120,619,600.00	0.55
39	601288	农业银行	41,825,504	117,111,411.20	0.54
40	600019	宝钢股份	19,370,000	116,801,100.00	0.54
41	000568	泸州老窖	2,526,000	113,973,120.00	0.52
42	600383	金地集团	17,472,000	111,995,520.00	0.52
43	600015	华夏银行	10,145,400	110,280,498.00	0.51
44	601699	潞安环能	3,342,000	109,651,020.00	0.50
45	600348	国阳新能	4,480,000	108,147,200.00	0.50
46	601766	中国南车	15,137,000	107,775,440.00	0.50
47	600256	广汇股份	4,500,000	107,010,000.00	0.49
48	000338	潍柴动力	2,350,000	106,760,500.00	0.49
49	600362	江西铜业	3,000,000	106,320,000.00	0.49
50	601628	中国人寿	5,490,600	102,948,750.00	0.47
51	600887	伊利股份	5,919,935	98,566,917.75	0.45
52	600739	辽宁成大	3,539,900	98,409,220.00	0.45
53	600068	葛洲坝	8,105,998	97,190,916.02	0.45
54	601168	西部矿业	6,130,000	90,846,600.00	0.42
55	600489	中金黄金	3,313,700	90,430,873.00	0.42
56	600196	复星医药	8,000,000	87,040,000.00	0.40
57	601600	中国铝业	7,880,000	86,758,800.00	0.40
58	600795	国电电力	29,000,000	85,840,000.00	0.39
59	601299	中国北车	12,590,000	84,353,000.00	0.39
60	000069	华侨城 A	10,500,000	83,055,000.00	0.38
61	600406	国电南瑞	2,278,000	82,691,400.00	0.38
62	000402	金融街	11,013,700	82,272,339.00	0.38
63	600010	包钢股份	9,800,000	81,830,000.00	0.38
64	600690	青岛海尔	2,908,000	81,278,600.00	0.37
65	000423	东阿阿胶	1,959,397	80,844,720.22	0.37
66	601988	中国银行	25,538,336	80,190,375.04	0.37
67	600188	兖州煤业	2,266,977	80,024,288.10	0.37
68	600999	招商证券	4,188,387	76,982,553.06	0.35
69	000425	徐工机械	3,030,970	75,137,746.30	0.35
70	000895	双汇发展	1,129,000	74,593,030.00	0.34
71	600309	烟台万华	3,985,800	74,574,318.00	0.34
72	601009	南京银行	8,280,000	74,271,600.00	0.34
73	600518	康美药业	5,590,000	73,564,400.00	0.34
74	601390	中国中铁	18,000,000	71,820,000.00	0.33
75	000009	中国宝安	4,159,000	71,617,980.00	0.33
76	000728	国元证券	6,300,000	71,190,000.00	0.33
77	000012	南玻 A	4,299,215	70,937,047.50	0.33
78	601618	中国中冶	18,000,000	70,920,000.00	0.33
79	000709	河北钢铁	15,650,000	70,738,000.00	0.33
80	600150	中国船舶	952,997	70,512,248.03	0.32
81	002202	金风科技	4,720,000	70,469,600.00	0.32
82	000623	吉林敖东	2,285,000	70,400,850.00	0.32
83	000039	中集集团	3,197,000	69,950,360.00	0.32
84	000060	中金岭南	5,239,000	69,678,700.00	0.32
85	601688	华泰证券	5,600,000	69,160,000.00	0.32

86	601919	中国远洋	8,328,000	69,039,120.00	0.32
87	601788	光大证券	5,004,820	68,816,275.00	0.32
88	601186	中国铁建	11,370,000	68,788,500.00	0.32
89	601958	金铂股份	3,573,000	68,780,250.00	0.32
90	601898	中煤能源	6,800,000	68,000,000.00	0.31
91	601607	上海医药	3,809,903	64,006,370.40	0.29
92	000937	冀中能源	2,518,000	63,831,300.00	0.29
93	600875	东方电气	2,480,000	63,240,000.00	0.29
94	601666	平煤股份	4,500,000	63,045,000.00	0.29
95	600276	恒瑞医药	2,084,744	62,479,777.68	0.29
96	000630	铜陵有色	2,590,000	62,419,000.00	0.29
97	600881	亚泰集团	7,442,800	61,998,524.00	0.29
98	600132	重庆啤酒	1,078,800	61,923,120.00	0.28
99	600415	小商品城	5,020,000	61,695,800.00	0.28
100	600029	南方航空	7,800,000	61,152,000.00	0.28
101	600005	武钢股份	14,640,000	60,756,000.00	0.28
102	002073	软控股份	2,927,196	60,300,237.60	0.28
103	002304	洋河股份	461,966	58,281,630.56	0.27
104	601111	中国国航	6,040,000	57,923,600.00	0.27
105	000538	云南白药	1,007,000	57,479,560.00	0.26
106	000100	TCL 集团	19,160,000	57,288,400.00	0.26
107	000401	冀东水泥	2,287,000	57,152,130.00	0.26
108	000933	神火股份	3,728,000	56,702,880.00	0.26
109	600058	五矿发展	1,605,000	55,019,400.00	0.25
110	000825	太钢不锈	10,600,000	54,590,000.00	0.25
111	600100	同方股份	5,158,000	53,952,680.00	0.25
112	000783	长江证券	5,009,480	53,952,099.60	0.25
113	600497	驰宏锌锗	2,433,533	53,659,402.65	0.25
114	600660	福耀玻璃	5,130,000	53,146,800.00	0.24
115	600642	申能股份	10,402,623	52,741,298.61	0.24
116	600123	兰花科创	1,250,900	52,262,602.00	0.24
117	601117	中国化学	5,892,900	52,211,094.00	0.24
118	600221	海南航空	7,200,000	51,408,000.00	0.24
119	600143	金发科技	3,120,000	51,355,200.00	0.24
120	600320	振华重工	7,697,391	51,187,650.15	0.24
121	601727	上海电气	7,379,996	51,069,572.32	0.23
122	000878	云南铜业	2,310,000	50,612,100.00	0.23
123	000768	西飞国际	4,588,585	50,520,320.85	0.23
124	000562	宏源证券	3,000,000	50,130,000.00	0.23
125	601106	中国一重	10,300,000	49,955,000.00	0.23
126	000422	湖北宜化	2,379,642	49,805,907.06	0.23
127	000960	锡业股份	1,706,100	49,647,510.00	0.23
128	600177	雅戈尔	5,000,000	49,350,000.00	0.23
129	000528	柳工	2,178,212	49,292,937.56	0.23
130	000758	中色股份	1,394,000	49,277,900.00	0.23
131	000725	京东方 A	17,640,000	48,157,200.00	0.22
132	600631	百联股份	3,199,950	47,615,256.00	0.22
133	600694	大商股份	1,238,817	47,359,973.91	0.22
134	600583	海油工程	7,330,000	47,058,600.00	0.22

135	000024	招商地产	2,570,000	47,031,000.00	0.22
136	600115	东方航空	9,000,000	46,800,000.00	0.22
137	600655	豫园商城	4,279,022	46,555,759.36	0.21
138	600153	建发股份	5,230,000	46,547,000.00	0.21
139	600832	东方明珠	6,000,000	46,500,000.00	0.21
140	000898	鞍钢股份	6,820,000	46,376,000.00	0.21
141	002142	宁波银行	4,250,000	46,240,000.00	0.21
142	600009	上海机场	3,582,700	45,858,560.00	0.21
143	601333	广深铁路	11,108,934	45,657,718.74	0.21
144	000778	新兴铸管	4,300,000	45,365,000.00	0.21
145	600550	天威保变	2,488,385	44,815,813.85	0.21
146	000800	一汽轿车	3,160,000	44,745,600.00	0.21
147	600741	华域汽车	4,004,100	44,565,633.00	0.20
148	600600	青岛啤酒	1,293,000	44,143,020.00	0.20
149	600271	航天信息	1,695,000	43,798,800.00	0.20
150	600549	厦门钨业	1,051,000	43,542,930.00	0.20
151	601001	大同煤业	2,537,000	43,129,000.00	0.20
152	600839	四川长虹	12,597,500	42,075,650.00	0.19
153	000680	山推股份	2,386,400	41,976,776.00	0.19
154	600664	哈药股份	2,663,900	41,823,230.00	0.19
155	002155	辰州矿业	1,255,000	41,025,950.00	0.19
156	600166	福田汽车	4,680,000	40,622,400.00	0.19
157	600418	江淮汽车	3,636,500	40,401,515.00	0.19
158	600395	盘江股份	1,197,000	39,728,430.00	0.18
159	000969	安泰科技	2,030,000	39,645,900.00	0.18
160	000729	燕京啤酒	2,318,000	39,336,460.00	0.18
161	000776	广发证券	999,949	39,247,998.25	0.18
162	002092	中泰化学	2,971,590	38,987,260.80	0.18
163	600582	天地科技	1,760,665	38,981,123.10	0.18
164	601808	中海油服	2,181,090	38,954,267.40	0.18
165	600331	宏达股份	2,900,000	38,599,000.00	0.18
166	600376	首开股份	2,919,990	38,573,067.90	0.18
167	601101	昊华能源	609,260	38,450,398.60	0.18
168	600997	开滦股份	2,399,900	38,302,404.00	0.18
169	600352	浙江龙盛	3,990,000	38,224,200.00	0.18
170	600970	中材国际	1,392,800	38,065,224.00	0.18
171	000625	长安汽车	4,096,473	37,482,727.95	0.17
172	600598	北大荒	2,650,000	37,100,000.00	0.17
173	601118	海南橡胶	2,988,800	36,822,016.00	0.17
174	000869	张裕 A	372,295	36,782,746.00	0.17
175	601179	中国西电	5,998,945	36,593,564.50	0.17
176	600219	南山铝业	3,867,000	36,388,470.00	0.17
177	600208	新潮中宝	5,820,000	36,258,600.00	0.17
178	600804	鹏博士	4,590,000	36,215,100.00	0.17
179	600169	太原重工	3,564,000	36,174,600.00	0.17
180	600125	铁龙物流	3,419,000	36,036,260.00	0.17
181	002007	华兰生物	1,060,000	35,976,400.00	0.17
182	600811	东方集团	5,090,000	35,019,200.00	0.16
183	600649	城投控股	4,240,000	34,428,800.00	0.16

184	600812	华北制药	2,983,000	34,364,160.00	0.16
185	600085	同仁堂	962,000	34,304,920.00	0.16
186	600809	山西汾酒	479,000	33,553,950.00	0.15
187	600316	洪都航空	1,040,000	33,519,200.00	0.15
188	600779	水井坊	1,492,100	33,452,882.00	0.15
189	000652	泰达股份	4,233,000	32,509,440.00	0.15
190	600266	北京城建	2,159,988	32,507,819.40	0.15
191	000807	云铝股份	3,010,889	32,397,165.64	0.15
192	600062	双鹤药业	1,304,079	32,328,118.41	0.15
193	600216	浙江医药	1,029,000	32,300,310.00	0.15
194	002128	露天煤业	1,482,198	32,237,806.50	0.15
195	601866	中海集运	8,819,000	32,101,160.00	0.15
196	600595	中孚实业	3,180,000	31,927,200.00	0.15
197	000061	农产品	2,000,000	31,920,000.00	0.15
198	002106	莱宝高科	1,050,920	31,790,330.00	0.15
199	002001	新和成	1,077,000	31,717,650.00	0.15
200	600535	天士力	766,562	31,528,695.06	0.15
201	600108	亚盛集团	5,190,000	31,503,300.00	0.14
202	002422	科伦药业	528,500	31,181,500.00	0.14
203	601818	光大银行	9,300,000	31,155,000.00	0.14
204	000876	新希望	1,557,000	31,062,150.00	0.14
205	600588	用友软件	1,500,000	30,990,000.00	0.14
206	600808	马钢股份	8,870,000	30,867,600.00	0.14
207	600300	维维股份	5,961,500	30,701,725.00	0.14
208	600516	方大炭素	2,328,000	30,566,640.00	0.14
209	000059	辽通化工	2,211,700	30,034,886.00	0.14
210	600018	上港集团	7,670,000	29,913,000.00	0.14
211	600879	航天电子	2,452,000	29,816,320.00	0.14
212	600703	三安光电	1,809,691	29,678,932.40	0.14
213	600118	中国卫星	1,317,102	29,516,255.82	0.14
214	600675	中华企业	4,335,630	29,482,284.00	0.14
215	601158	重庆水务	3,560,000	29,405,600.00	0.14
216	600635	大众公用	4,912,530	28,983,927.00	0.13
217	600456	宝钛股份	1,000,920	28,886,551.20	0.13
218	000559	万向钱潮	3,568,457	28,690,394.28	0.13
219	600500	中化国际	2,850,000	28,471,500.00	0.13
220	600428	中远航运	3,866,170	27,913,747.40	0.13
221	600546	山煤国际	889,853	27,754,515.07	0.13
222	000968	煤气化	1,080,000	27,356,400.00	0.13
223	002122	天马股份	2,132,000	27,289,600.00	0.13
224	600239	云南城投	2,118,600	27,245,196.00	0.13
225	000021	长城开发	3,276,822	27,132,086.16	0.12
226	600895	张江高科	2,865,000	27,045,600.00	0.12
227	600037	歌华有线	2,638,000	26,881,220.00	0.12
228	600893	航空动力	1,550,000	26,799,500.00	0.12
229	601918	国投新集	2,200,000	26,752,000.00	0.12
230	000999	华润三九	1,485,000	26,655,750.00	0.12
231	600269	赣粤高速	5,649,940	26,611,217.40	0.12
232	000027	深圳能源	3,524,574	26,575,287.96	0.12

233	600432	吉恩镍业	1,175,000	26,179,000.00	0.12
234	600066	宇通客车	1,131,000	26,171,340.00	0.12
235	600508	上海能源	1,069,000	26,051,530.00	0.12
236	600369	西南证券	2,190,000	25,995,300.00	0.12
237	000686	东北证券	1,290,000	25,929,000.00	0.12
238	002493	荣盛石化	829,111	25,611,238.79	0.12
239	601888	中国国旅	1,080,000	25,520,400.00	0.12
240	002146	荣盛发展	2,600,000	25,480,000.00	0.12
241	600717	天津港	3,080,000	25,194,400.00	0.12
242	600170	上海建工	1,550,000	24,164,500.00	0.11
243	600312	平高电气	2,375,000	24,106,250.00	0.11
244	000780	平庄能源	1,510,000	24,009,000.00	0.11
245	600528	中铁二局	2,710,000	23,549,900.00	0.11
246	600220	江苏阳光	4,650,000	23,436,000.00	0.11
247	600737	中粮屯河	2,276,216	23,331,214.00	0.11
248	000959	首钢股份	5,200,000	22,984,000.00	0.11
249	600008	首创股份	4,060,000	22,979,600.00	0.11
250	600380	健康元	2,494,115	22,970,799.15	0.11
251	000951	中国重汽	1,224,656	22,631,642.88	0.10
252	000612	焦作万方	1,256,400	22,414,176.00	0.10
253	000690	宝新能源	4,356,492	21,869,589.84	0.10
254	600109	国金证券	1,480,569	21,542,278.95	0.10
255	000961	中南建设	2,025,000	21,343,500.00	0.10
256	600096	云天化	1,069,000	21,262,410.00	0.10
257	600718	东软集团	1,865,994	21,235,011.72	0.10
258	000718	苏宁环球	2,600,000	20,800,000.00	0.10
259	601933	永辉超市	850,921	20,583,778.99	0.09
260	600859	王府井	500,000	19,985,000.00	0.09
261	601718	际华集团	4,299,000	19,775,400.00	0.09
262	600026	中海发展	2,340,000	19,749,600.00	0.09
263	600674	川投能源	1,359,000	19,488,060.00	0.09
264	600863	内蒙华电	2,192,000	19,421,120.00	0.09
265	600823	世茂股份	1,327,374	19,419,481.62	0.09
266	000031	中粮地产	3,350,000	19,162,000.00	0.09
267	002244	滨江集团	1,539,000	18,929,700.00	0.09
268	601369	陕鼓动力	1,711,925	18,779,817.25	0.09
269	600151	航天机电	1,620,000	18,678,600.00	0.09
270	601098	中南传媒	1,949,607	18,579,754.71	0.09
271	002310	东方园林	206,000	18,540,000.00	0.09
272	600517	置信电气	1,488,000	17,960,160.00	0.08
273	002385	大北农	535,600	17,353,440.00	0.08
274	600307	酒钢宏兴	3,046,000	16,692,080.00	0.08
275	600183	生益科技	1,800,000	16,524,000.00	0.08
276	600161	天坛生物	960,000	16,272,000.00	0.07
277	600971	恒源煤电	400,000	16,144,000.00	0.07
278	600004	白云机场	2,000,000	15,780,000.00	0.07
279	601717	郑煤机	417,831	15,234,118.26	0.07
280	002028	思源电气	1,096,200	15,006,978.00	0.07
281	002399	海普瑞	380,000	14,709,800.00	0.07

282	002405	四维图新	469,859	14,636,107.85	0.07
283	002415	海康威视	372,000	14,615,880.00	0.07
284	601268	二重重装	1,330,369	14,421,199.96	0.07
285	002294	信立泰	411,200	13,812,208.00	0.06
286	601107	四川成渝	2,400,000	13,488,000.00	0.06
287	000927	一汽夏利	1,827,000	12,898,620.00	0.06
288	000536	华映科技	532,000	12,353,040.00	0.06
289	002069	獐子岛	507,129	12,323,234.70	0.06
290	002500	山西证券	1,228,200	11,238,030.00	0.05
291	000685	中山公用	669,000	11,132,160.00	0.05
292	002498	汉缆股份	506,895	9,798,280.35	0.05
293	601377	兴业证券	500,000	8,615,000.00	0.04
294	601519	大智慧	534,600	8,361,144.00	0.04
295	000046	泛海建设	550,480	4,833,214.40	0.02
296	601018	宁波港	1,500,000	4,800,000.00	0.02
297	601798	蓝科高新	264,845	3,514,493.15	0.02
298	600210	紫江企业	500,000	3,000,000.00	0.01
299	601558	华锐风电	99,980	2,922,415.40	0.01
300	600267	海正药业	15,600	582,504.00	0.00

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	600837	海通证券	160,757,852.81	0.71
2	600481	双良节能	121,362,108.73	0.53
3	601988	中国银行	88,715,657.90	0.39
4	000630	铜陵有色	76,653,415.26	0.34
5	600406	国电南瑞	71,718,012.28	0.32
6	600585	海螺水泥	68,565,405.66	0.30
7	600887	伊利股份	63,350,508.72	0.28
8	601101	昊华能源	60,553,203.24	0.27
9	002073	软控股份	59,080,450.35	0.26
10	600276	恒瑞医药	57,435,455.33	0.25
11	600115	东方航空	56,593,259.99	0.25
12	600703	三安光电	54,293,074.77	0.24
13	601288	农业银行	48,759,744.44	0.21
14	601989	中国重工	44,332,272.59	0.20
15	000157	中联重科	44,209,251.08	0.19
16	000012	南玻 A	40,340,298.61	0.18
17	002422	科伦药业	40,134,371.31	0.18
18	600535	天士力	37,221,486.50	0.16
19	600582	天地科技	37,168,403.82	0.16
20	000869	张裕 A	35,961,234.11	0.16

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	601939	建设银行	137,785,952.76	0.61
2	600016	民生银行	102,272,942.45	0.45
3	601318	中国平安	82,803,404.33	0.36
4	600036	招商银行	69,376,170.16	0.31
5	601166	兴业银行	62,041,893.10	0.27
6	601088	中国神华	57,594,107.94	0.25
7	600018	上港集团	55,490,157.96	0.24
8	601601	中国太保	45,991,698.80	0.20
9	000002	万科A	44,431,417.06	0.20
10	600837	海通证券	43,601,463.38	0.19
11	601328	交通银行	41,944,000.00	0.18
12	601006	大秦铁路	41,569,665.18	0.18
13	600881	亚泰集团	35,899,340.86	0.16
14	600601	方正科技	35,220,992.03	0.15
15	600703	三安光电	34,719,599.93	0.15
16	600519	贵州茅台	34,582,081.23	0.15
17	600210	紫江企业	33,403,408.80	0.15
18	600325	华发股份	33,182,550.49	0.15
19	000858	五粮液	33,002,446.44	0.15
20	000001	深发展A	32,092,782.70	0.14

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,292,708,558.69
卖出股票收入（成交）总额	3,586,225,458.59

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

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	277,265,875.80	1.28
2	央行票据	241,475,000.00	1.11
3	金融债券	357,318,000.00	1.64
	其中：政策性金融债	357,318,000.00	1.64
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	876,058,875.80	4.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101018	11 央行票据 18	2,500,000	241,475,000.00	1.11
2	019101	11 国债 01	1,000,000	100,010,000.00	0.46
3	019109	11 国债 09	1,000,000	99,970,000.00	0.46
4	080222	08 国开 22	1,000,000	99,320,000.00	0.46
5	090405	09 农发 05	1,000,000	98,630,000.00	0.45

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 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	1,514,503.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	23,775,856.84
4	应收利息	9,225,584.10
5	应收申购款	5,949,228.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,465,173.25

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
624,787	40,199.28	1,382,851,930.43	5.51%	23,733,134,507.64	94.49%

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	6,064,842.06	0.02%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 7 月 10 日）基金份额总额	24,771,957,170.09
本报告期期初基金份额总额	25,736,288,433.15
本报告期基金总申购份额	3,427,809,839.34
减：本报告期基金总赎回份额	4,048,111,834.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,115,986,438.07

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的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等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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	
海通证券	1	4,734,941,060.77	70.15%	236,736.28	87.10%	-
中银国际证券	1	1,751,590,528.98	25.95%	21,896.55	8.06%	-
华泰联合证券	1	263,498,232.35	3.90%	13,174.29	4.85%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了光大证券、广发证券、国金证券、中投证券和中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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	
	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
海通证券	233,188,893.60	98.33%	1,550,000,000.00	75.74%
中银国际证券	3,961,467.00	1.67%	-	-
华泰联合证券	-	-	496,600,000.00	24.26%

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	华夏基金管理有限公司关于设立杭州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-01-05
2	华夏基金管理有限公司关于在中国银行股	中国证监会指定	2011-03-09

	份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	报刊及网站	
3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信证券股份有限公司办理定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-11
4	华夏基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-31
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金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	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-01
6	华夏基金管理有限公司关于在中国农业银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-07
7	华夏基金管理有限公司关于调整基金分红方式变更规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-25
8	华夏基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-05-13
9	关于停止中行广东省分行长城借记卡基金网上交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-05-28
10	华夏基金管理有限公司关于在上海浦东发展银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-17
11	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-23
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-30

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 11.1.2 《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付

工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日