

广发沪深 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：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

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.....	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.....	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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对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）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41

7.9 投资组合报告附注.....	41
8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
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.....	42
9 开放式基金份额变动.....	42
10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	48
11 备查文件目录.....	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发沪深300指数证券投资基金
基金简称	广发沪深300指数
基金主代码	270010
交易代码	270010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月30日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	2,743,917,339.81份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，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小于0.35%。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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	广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军
	联系电话	020-83936666
		赵会军
		010-66105799

	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		王志伟	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.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利 国际广场南塔 31-33 楼

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	5,368,116.95
本期利润	-110,304,256.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0430
本期加权平均净值利润率	-3.24%
本期基金份额净值增长率	-2.11%
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	23,102,272.25
期末可供分配基金份额利润	0.0084
期末基金资产净值	3,557,703,233.91
期末基金份额净值	1.297

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	58.71%

注：(1) 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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.05%	1.14%	1.35%	1.13%	0.70%	0.01%
过去三个月	-4.63%	1.05%	-5.28%	1.04%	0.65%	0.01%
过去六个月	-2.11%	1.16%	-2.54%	1.17%	0.43%	-0.01%
过去一年	17.69%	1.33%	17.85%	1.33%	-0.16%	0.00%
自基金成立起至今	58.71%	1.62%	60.98%	1.65%	-2.27%	-0.03%

注：(1) 业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

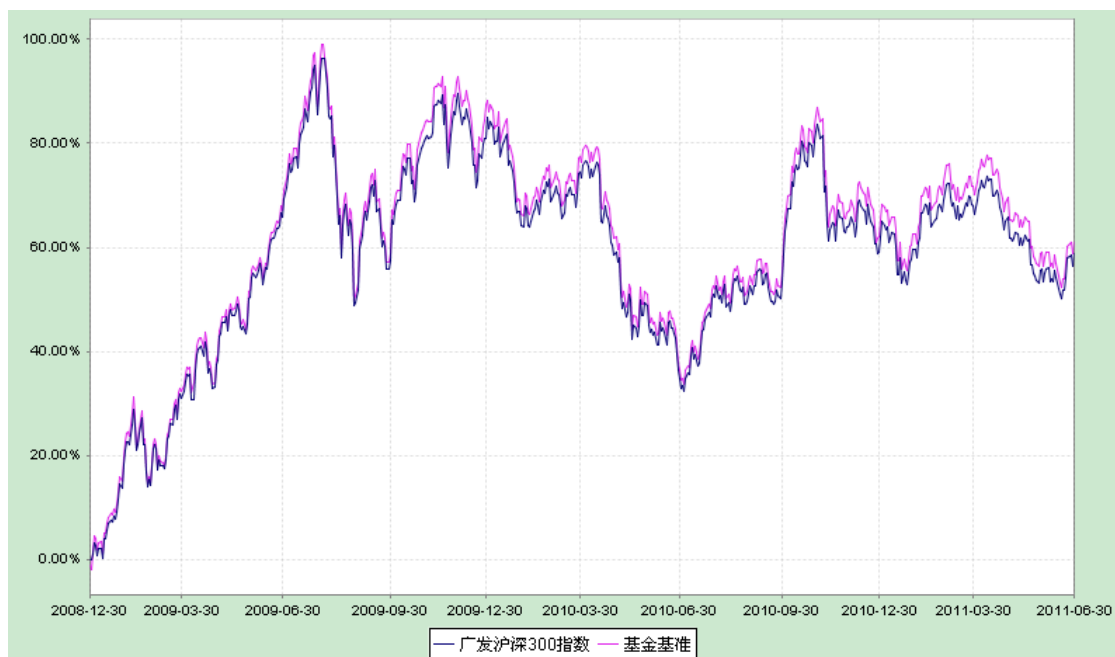
(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发沪深 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

(2008 年 12 月 30 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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司具有企业年金投资管理人、QDII、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和17个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至2011年6月30日，本基金管理人管理十九只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券

投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太 (除日本) 精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和广发标普全球农业指数证券投资基金, 管理资产规模为 1022.81 亿元。同时, 公司还管理着多个企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

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		
陈盛业	本基金的基金经理; 广发中证 500 指数 (lof) 的基金经理	2010-12-01	-	4	男, 中国籍, 经济学博士, 持有证券业执业证书, 2007 年 3 月至 2009 年 9 月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管, 2009 年 9 月至 2010 年 8 月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理, 2010 年 8 月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作, 2010 年 12 月 1 日起任广发沪深 300 指数基金及广发中证 500 指数 (lof) 基金的基金经理。
魏军	本基金的基金经理助理; 广发中证 500 指数 (lof) 的基金经理助理	2010-03-11	-	3	男, 中国籍, 经济学博士, 持有证券业执业资格证书, 2008 年 7 月至今任广发基金管理有限公司研究员, 2010 年 3 月 11 日起任广发沪深 300 指数基金、广发中证 500 指数基金的基金经理助理。

注: 1. 基金经理的“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

监察稽核部风险控制管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；监察稽核部稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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

本基金管理人未管理与本投资组合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

本报告期内，本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.04%，符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的限制。

报告期内，本基金跟踪误差来源主要有两个：一是基金成份股调整因素，本基金季度末的成份股调整策略合理，较好的控制了该因素带来的误差；二是申购和赎回因素，本基金成立以来规模稳步增长，目前的规模水平下，申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2) 简要展望

作为指数基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.297 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.11%，业绩比较基准收益率为 -2.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在目前紧缩的政策环境下，以沪深 300 为代表的蓝筹公司表现出了较强的抗风险能力。预期未来一段时间，我国的通胀还会保持在一个较高的水平，这也就意味着紧缩政策不会有大的改观，沪深 300 指数更适合低风险偏好的投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行

核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期间未分配利润，本期末本基金可供分配利润为 23,102,272.25 元。

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，本基金托管人在对广发沪深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，广发沪深300指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发沪深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，广发沪深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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发沪深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：广发沪深 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	86,391,845.08	159,169,188.40
结算备付金		2,178,528.07	632,224.57
存出保证金		1,154,713.26	665,205.50
交易性金融资产	6.4.7.2	3,369,368,954.16	2,812,999,871.91
其中：股票投资		3,369,368,954.16	2,812,600,403.40
基金投资		-	-
债券投资		-	399,468.51
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,000.00	-
应收证券清算款		-	56,934,397.83
应收利息	6.4.7.5	52,767.97	30,718.99
应收股利		3,877,886.81	-
应收申购款		3,407,225.40	16,682,494.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,566,431,920.75	3,047,114,101.87
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		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		3,856,583.88	83,547,277.87
应付管理人报酬		2,190,316.34	1,984,174.60
应付托管费		438,063.25	396,834.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,042,294.33	1,625,816.60
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	201,429.04	394,787.90
负债合计		8,728,686.84	87,948,891.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,743,917,339.81	2,233,184,691.42
未分配利润	6.4.7.10	813,785,894.10	725,980,518.57
所有者权益合计		3,557,703,233.91	2,959,165,209.99
负债和所有者权益总计		3,566,431,920.75	3,047,114,101.87

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.297 元，基金份额总额 2,743,917,339.81 份。

6.2 利润表

会计主体：广发沪深 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		-91,401,680.65	-767,303,235.88
1.利息收入		843,630.70	567,207.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	646,605.76	563,171.79
债券利息收入		6,889.10	4,035.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		190,135.84	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,278,326.00	115,547,172.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,710,421.54	101,149,143.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-765,250.49	123,013.67
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	31,753,998.03	14,275,015.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-115,672,373.56	-884,736,674.91
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	1,148,736.21	1,319,059.26
减：二、费用		18,902,575.96	14,880,770.72
1. 管理人报酬		12,598,652.50	9,443,273.96
2. 托管费		2,519,730.43	1,888,654.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,590,555.01	3,355,133.84
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	193,638.02	193,708.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-110,304,256.61	-782,184,006.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-110,304,256.61	-782,184,006.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪深 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）	2,233,184,691.42	725,980,518.57	2,959,165,209.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-110,304,256.61	-110,304,256.61
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）	510,732,648.39	198,109,632.14	708,842,280.53
其中：1. 基金申购款	1,259,663,733.80	434,807,651.27	1,694,471,385.07
2. 基金赎回款	-748,931,085.41	-236,698,019.13	-985,629,104.54

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）	2,743,917,339.81	813,785,894.10	3,557,703,233.91
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）	1,551,828,038.23	1,051,520,441.61	2,603,348,479.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-782,184,006.60	-782,184,006.60
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）	340,824,329.72	154,367,620.15	495,191,949.87
其中：1. 基金申购款	1,117,116,480.01	549,919,979.37	1,667,036,459.38
2. 基金赎回款	-776,292,150.29	-395,552,359.22	-1,171,844,509.51
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）	1,892,652,367.95	423,704,055.16	2,316,356,423.11

报告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：王志伟，主管会计工作负责人：林传辉，会计机构负责人：张晓

章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发沪深 300 指数证券投资基金（“本基金”）经证监许可[2008]1295 号文《关于核准广发沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2008 年 12 月 30 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公

司。本基金已向中国证券监督管理委员会备案，并获基金部函(2008)545 号《关于广发沪深 300 指数证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为 2008 年 12 月 8 日至 2008 年 12 月 26 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 653,693,988.31 元，有效认购户数为 12,912 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 44,015.09 元，折合基金份额 44,015.09 份，按照《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2008 年 12 月 30 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 653,693,988.31 份。

根据《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》等有关规定和基金合同的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、到期日在一年以内的政府债券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准采用： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 银行同业存款收益率。

本基金的财务报表于 2011 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、基金合同、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》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《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 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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，不缴纳营业税。
- 2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，上市公司在代扣代缴时，减按 50% 计算应纳税所得额。
- 4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5、对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳证券（股票）交易印花税。
- 6、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，暂免于缴纳印花税、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	86,391,845.08
定期存款	-
其他存款	-
合计	86,391,845.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,418,665,267.35	3,369,368,954.16	-49,296,313.19
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	3,418,665,267.35	3,369,368,954.16	-49,296,313.19

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工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上海证券交易所市场	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

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	17,429.33
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	882.27
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	34,456.37
应收申购款利息	-
其他	-
合计	52,767.97

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,042,294.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,042,294.33

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	-
应付赎回费	12,989.94
预提费用	188,439.10
合计	201,429.04

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	2,233,184,691.42	2,233,184,691.42
本期申购	1,259,663,733.80	1,259,663,733.80
本期赎回（以“-”号填列）	-748,931,085.41	-748,931,085.41
本期末	2,743,917,339.81	2,743,917,339.81

注：本期申购含红利再投资和转换转入份（金）额；本期赎回含转换转出份（金）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
上年度末	16,852,760.27	709,127,758.30	725,980,518.57
本期利润	5,368,116.95	-115,672,373.56	-110,304,256.61
本期基金份额交易产生的变动数	881,395.03	197,228,237.11	198,109,632.14
其中：基金申购款	3,647,039.01	431,160,612.26	434,807,651.27
基金赎回款	-2,765,643.98	-233,932,375.15	-236,698,019.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,102,272.25	790,683,621.85	813,785,894.10

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	599,357.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	27,583.99
结算备付金利息收入	19,664.33
其他	-
合计	646,605.76

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	940,244,587.98
减：卖出股票成本总额	948,955,009.52
买卖股票差价收入	-8,710,421.54

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	19,412,198.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,157,150.43
减：应收利息总额	20,298.77
债券投资收益	-765,250.49

6.4.7.14 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	31,753,998.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,753,998.03

6.4.7.15 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	-115,672,373.56
——股票投资	-115,569,005.05
——债券投资	-103,368.51
——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	-115,672,373.56

6.4.7.16 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	813,784.21
转换费收入	334,952.00
合计	1,148,736.21

6.4.7.17 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	3,590,555.01
银行间市场交易费用	-
合计	3,590,555.01

6.4.7.18 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	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	5,198.92
合计	193,638.02

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的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

本基金本报告期新增关联方广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)，为基金管理人的全资子公司。

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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构

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
广发证券股份有限公司	950,723,990.98	37.30%	2,085,362,658.16	88.70%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	8,114,005.00	38.81%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	805,217.81	37.54%	496,213.51	24.30%
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
广发证券股份有限公司	1,753,283.80	88.71%	429,821.95	65.82%

注：1：股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)；

2：本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3：本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,598,652.50	9,443,273.96
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,331,992.17	1,496,375.29

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75 %的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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	2,519,730.43	1,888,654.80

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联交易对手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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无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

本报告期末及上年度末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
中国工商银行股份有限公司	86,391,845.08	599,357.44	123,151,459.68	507,762.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券的流通受限证券。

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
000652	泰达股份	2010-11-22	重大 事项	7.68	2011-07-08	7.68	572,820	4,462,572.36	4,399,257.60	-
000876	新希望	2011-06-29	重大 事项	19.95	2011-07-05	21.95	259,908	3,718,784.00	5,185,164.60	-
000959	首钢股份	2010-10-29	重大 事项	4.42	未复牌	-	773,655	3,450,212.03	3,419,555.10	-
600216	浙江医药	2011-06-27	重大 事项	31.39	2011-07-04	32.60	168,660	5,359,855.11	5,294,237.40	-
600369	西南证券	2011-03-01	重大 事项	11.87	2011-08-16	12.49	239,865	3,653,657.34	2,847,197.55	-

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

截至本报告期末止，本基金无银行间市场债券正回购交易余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末止，本基金无交易所市场债券正回购交易余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理体系的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，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。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

2011 年 6 月 30 日，本基金未持有债券，因此与债券相关的信用风险不重大。本基金上年度可比期间未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	86,391,845.08	-	-	-	86,391,845.08
结算备付金	2,178,528.07	-	-	-	2,178,528.07
存出保证金	-	-	-	1,154,713.26	1,154,713.26
交易性金融 资产	-	-	-	3,369,368,954.16	3,369,368,954.16
买入返售金 融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收股利	-	-	-	3,877,886.81	3,877,886.81
应收利息	-	-	-	52,767.97	52,767.97
应收申购款	-	-	-	3,407,225.40	3,407,225.40
应收证券清 算款	-	-	-	-	-
资产总计	188,570,373.15	-	-	3,377,861,547.60	3,566,431,920.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,856,583.88	3,856,583.88
应付管理人 报酬	-	-	-	2,190,316.34	2,190,316.34
应付托管费	-	-	-	438,063.25	438,063.25
应付交易费 用	-	-	-	2,042,294.33	2,042,294.33
其他负债	-	-	-	201,429.04	201,429.04
负债总计	-	-	-	8,728,686.84	8,728,686.84
利率敏感度 缺口	188,570,373.15	-	-	3,369,132,860.76	3,557,703,233.91
上年度末 2010年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	159,169,188.40	-	-	-	159,169,188.40
结算备付金	632,224.57	-	-	-	632,224.57
存出保证金	-	-	-	665,205.50	665,205.50
交易性金融资产	399,468.51	-	-	2,812,600,403.40	2,812,999,871.91
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	30,718.99	30,718.99
应收申购款	16,682,494.67	-	-	-	16,682,494.67
应收证券清算款	-	-	-	56,934,397.83	56,934,397.83
资产总计	176,883,376.15	-	-	2,870,230,725.72	3,047,114,101.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	83,547,277.87	83,547,277.87
应付管理人报酬	-	-	-	1,984,174.60	1,984,174.60
应付托管费	-	-	-	396,834.91	396,834.91
应付交易费用	-	-	-	1,625,816.60	1,625,816.60
其他负债	-	-	-	394,787.90	394,787.90
负债总计	-	-	-	87,948,891.88	87,948,891.88
利率敏感度缺口	176,883,376.15	-	-	2,782,281,833.84	2,959,165,209.99

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行了分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变动且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）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25个基点	-	-4,153.68
	市场利率下降25个基点	-	4,209.91

注：于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资，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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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	3,369,368,954.16	94.71	2,812,600,403.40	95.05
交易性金融资产-债券投资	-	-	399,468.51	0.01
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,369,368,954.16	94.71	2,812,999,871.91	95.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2011年6月30日	2010年12月31日
	业绩比较基准上升5%	199,996,287.29	159,399,502.89
业绩比较基准下降5%	-199,996,287.29	-159,399,502.89	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

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	3,369,368,954.16	94.47
	其中：股票	3,369,368,954.16	94.47
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	100,000,000.00	2.80
	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	88,570,373.15	2.48
6	其他各项资产	8,492,593.44	0.24
7	合计	3,566,431,920.75	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	11,484,333.52	0.32
B	采掘业	406,832,583.80	11.44
C	制造业	1,201,931,961.62	33.78
C0	食品、饮料	197,701,620.97	5.56
C1	纺织、服装、皮毛	12,162,986.22	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,213,698.55	2.42
C5	电子	28,589,472.52	0.80
C6	金属、非金属	312,457,694.56	8.78
C7	机械、设备、仪表	439,816,975.79	12.36
C8	医药、生物制品	114,426,793.75	3.22
C99	其他制造业	10,562,719.26	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,376,895.69	2.20
E	建筑业	102,757,033.60	2.89

F	交通运输、仓储业	140,219,168.17	3.94
G	信息技术业	110,396,011.89	3.10
H	批发和零售贸易	80,986,761.60	2.28
I	金融、保险业	935,145,251.22	26.29
J	房地产业	193,552,102.05	5.44
K	社会服务业	32,446,940.84	0.91
L	传播与文化产业	4,048,588.90	0.11
M	综合类	71,191,321.26	2.00
	合计	3,369,368,954.16	94.71

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	601318	中国平安	2,092,201	100,990,542.27	2.84
2	600036	招商银行	7,722,306	100,544,424.12	2.83
3	600030	中信证券	6,362,128	83,216,634.24	2.34
4	600016	民生银行	14,105,048	80,821,925.04	2.27
5	601328	交通银行	12,998,084	72,009,385.36	2.02
6	600000	浦发银行	6,989,022	68,771,976.48	1.93
7	601166	兴业银行	4,714,967	63,557,755.16	1.79
8	601288	农业银行	22,570,500	63,197,400.00	1.78
9	601088	中国神华	2,059,638	62,077,489.32	1.74
10	000002	万科A	6,759,644	57,118,991.80	1.61
11	600519	贵州茅台	235,697	50,116,253.11	1.41
12	601601	中国太保	1,962,858	43,948,390.62	1.24
13	000858	五粮液	1,185,196	42,335,201.12	1.19
14	601668	中国建筑	10,188,200	41,058,446.00	1.15
15	600585	海螺水泥	1,248,860	34,668,353.60	0.97
16	600031	三一重工	1,896,824	34,218,704.96	0.96
17	002024	苏宁电器	2,621,310	33,578,981.10	0.94
18	600111	包钢稀土	453,769	32,412,719.67	0.91
19	601006	大秦铁路	3,713,493	30,413,507.67	0.85
20	000001	深发展A	1,740,974	29,718,426.18	0.84
21	601939	建设银行	5,990,872	29,594,907.68	0.83
22	000651	格力电器	1,231,770	28,946,595.00	0.81
23	600837	海通证券	3,082,801	27,806,865.02	0.78
24	600050	中国联通	5,294,588	27,796,587.00	0.78
25	601169	北京银行	2,722,246	27,140,792.62	0.76

26	601857	中国石油	2,346,382	25,552,099.98	0.72
27	000063	中兴通讯	877,544	24,816,944.32	0.70
28	600048	保利地产	2,228,660	24,492,973.40	0.69
29	601899	紫金矿业	3,289,573	23,816,508.52	0.67
30	000983	西山煤电	983,928	23,811,057.60	0.67
31	601989	中国重工	1,708,028	23,553,706.12	0.66
32	000527	美的电器	1,268,025	23,318,979.75	0.66
33	000157	中联重科	1,507,318	23,182,550.84	0.65
34	600900	长江电力	3,091,113	22,286,924.73	0.63
35	600104	上海汽车	1,154,316	21,631,881.84	0.61
36	600028	中国石化	2,600,235	21,399,934.05	0.60
37	600089	特变电工	1,645,786	21,296,470.84	0.60
38	600547	山东黄金	444,282	19,921,604.88	0.56
39	600019	宝钢股份	3,280,712	19,782,693.36	0.56
40	000568	泸州老窖	435,340	19,642,540.80	0.55
41	601699	潞安环能	574,730	18,856,891.30	0.53
42	600015	华夏银行	1,710,997	18,598,537.39	0.52
43	600362	江西铜业	518,320	18,369,260.80	0.52
44	600348	国阳新能	750,883	18,126,315.62	0.51
45	600383	金地集团	2,792,323	17,898,790.43	0.50
46	000338	潍柴动力	393,858	17,892,968.94	0.50
47	000792	盐湖股份	297,977	17,580,643.00	0.49
48	601628	中国人寿	936,667	17,562,506.25	0.49
49	601766	中国南车	2,451,894	17,457,485.28	0.49
50	600256	广汇股份	729,493	17,347,343.54	0.49
51	600795	国电电力	5,767,965	17,073,176.40	0.48
52	600887	伊利股份	998,340	16,622,361.00	0.47
53	600489	中金黄金	577,669	15,764,587.01	0.44
54	600068	葛洲坝	1,306,706	15,667,404.94	0.44
55	601168	西部矿业	1,041,686	15,437,786.52	0.43
56	600406	国电南瑞	393,552	14,285,937.60	0.40
57	600690	青岛海尔	502,049	14,032,269.55	0.39
58	601299	中国北车	2,073,200	13,890,440.00	0.39
59	000069	华侨城 A	1,746,412	13,814,118.92	0.39
60	601988	中国银行	4,353,528	13,670,077.92	0.38
61	000423	东阿阿胶	326,712	13,480,137.12	0.38
62	600010	包钢股份	1,604,525	13,397,783.75	0.38
63	601600	中国铝业	1,196,531	13,173,806.31	0.37
64	600188	兖州煤业	363,292	12,824,207.60	0.36
65	601390	中国中铁	3,202,059	12,776,215.41	0.36
66	000425	徐工机械	515,270	12,773,543.30	0.36

67	600309	烟台万华	675,103	12,631,177.13	0.36
68	000895	双汇发展	188,176	12,432,788.32	0.35
69	002202	金风科技	822,255	12,276,267.15	0.35
70	000060	中金岭南	901,768	11,993,514.40	0.34
71	601618	中国中冶	3,042,200	11,986,268.00	0.34
72	601919	中国远洋	1,430,412	11,858,115.48	0.33
73	002001	新 和 成	402,256	11,846,439.20	0.33
74	000039	中集集团	538,513	11,782,664.44	0.33
75	601788	光大证券	853,813	11,739,928.75	0.33
76	000009	中国宝安	681,098	11,728,507.56	0.33
77	000709	河北钢铁	2,576,572	11,646,105.44	0.33
78	601009	南京银行	1,297,820	11,641,445.40	0.33
79	601958	金铂股份	604,423	11,635,142.75	0.33
80	601898	中煤能源	1,142,983	11,429,830.00	0.32
81	000402	金 融 街	1,512,275	11,296,694.25	0.32
82	000937	冀中能源	433,248	10,982,836.80	0.31
83	000630	铜陵有色	443,890	10,697,749.00	0.30
84	600875	东方电气	415,616	10,598,208.00	0.30
85	600276	恒瑞医药	350,962	10,518,331.14	0.30
86	600005	武钢股份	2,521,270	10,463,270.50	0.29
87	600415	小商品城	849,824	10,444,336.96	0.29
88	600999	招商证券	567,106	10,423,408.28	0.29
89	600132	重庆啤酒	181,310	10,407,194.00	0.29
90	601666	平煤股份	737,234	10,328,648.34	0.29
91	600029	南方航空	1,315,580	10,314,147.20	0.29
92	601607	上海医药	600,429	10,087,207.20	0.28
93	601111	中国国航	1,040,242	9,975,920.78	0.28
94	000538	云南白药	173,448	9,900,411.84	0.28
95	600881	亚泰集团	1,183,209	9,856,130.97	0.28
96	000933	神火股份	629,456	9,574,025.76	0.27
97	000783	长江证券	888,476	9,568,886.52	0.27
98	000528	柳 工	421,573	9,540,196.99	0.27
99	000100	TCL 集团	3,175,840	9,495,761.60	0.27
100	000401	冀东水泥	378,619	9,461,688.81	0.27
101	600150	中国船舶	124,129	9,184,304.71	0.26
102	600058	五矿发展	267,730	9,177,784.40	0.26
103	600100	同方股份	868,856	9,088,233.76	0.26
104	600660	福耀玻璃	875,507	9,070,252.52	0.25
105	600497	驰宏锌锗	409,092	9,020,478.60	0.25
106	600642	申能股份	1,771,806	8,983,056.42	0.25
107	000825	太钢不锈	1,743,274	8,977,861.10	0.25

108	600123	兰花科创	213,967	8,939,541.26	0.25
109	601688	华泰证券	699,418	8,637,812.30	0.24
110	600143	金发科技	523,188	8,611,674.48	0.24
111	000878	云南铜业	392,402	8,597,527.82	0.24
112	000768	西飞国际	773,580	8,517,115.80	0.24
113	601727	上海电气	1,230,310	8,513,745.20	0.24
114	000758	中色股份	239,387	8,462,330.45	0.24
115	000725	京东方 A	3,043,080	8,307,608.40	0.23
116	000960	锡业股份	283,021	8,235,911.10	0.23
117	600177	雅戈尔	834,266	8,234,205.42	0.23
118	601117	中国化学	924,100	8,187,526.00	0.23
119	000012	南玻 A	492,196	8,121,234.00	0.23
120	601106	中国一重	1,633,100	7,920,535.00	0.22
121	000024	招商地产	430,266	7,873,867.80	0.22
122	002142	宁波银行	720,322	7,837,103.36	0.22
123	000898	鞍钢股份	1,151,935	7,833,158.00	0.22
124	600655	豫园商城	718,012	7,811,970.56	0.22
125	600583	海油工程	1,214,437	7,796,685.54	0.22
126	600550	天威保变	428,662	7,720,202.62	0.22
127	600832	东方明珠	994,878	7,710,304.50	0.22
128	600009	上海机场	601,620	7,700,736.00	0.22
129	600115	东方航空	1,457,900	7,581,080.00	0.21
130	000778	新兴铸管	718,233	7,577,358.15	0.21
131	600153	建发股份	838,455	7,462,249.50	0.21
132	600271	航天信息	288,304	7,449,775.36	0.21
133	600600	青岛啤酒	217,275	7,417,768.50	0.21
134	600320	振华重工	1,102,891	7,334,225.15	0.21
135	600664	哈药股份	465,336	7,305,775.20	0.21
136	601333	广深铁路	1,764,786	7,253,270.46	0.20
137	000800	一汽轿车	508,160	7,195,545.60	0.20
138	600741	华域汽车	645,265	7,181,799.45	0.20
139	601001	大同煤业	418,084	7,107,428.00	0.20
140	002304	洋河股份	56,246	7,095,995.36	0.20
141	000422	湖北宜化	338,709	7,089,179.37	0.20
142	600549	厦门钨业	170,326	7,056,606.18	0.20
143	600694	大商股份	183,464	7,013,828.72	0.20
144	600395	盘江股份	206,721	6,861,069.99	0.19
145	600166	福田汽车	790,412	6,860,776.16	0.19
146	601998	中信银行	1,437,420	6,827,745.00	0.19
147	002155	辰州矿业	205,118	6,705,307.42	0.19
148	000680	山推股份	379,296	6,671,816.64	0.19

149	600535	天士力	161,200	6,630,156.00	0.19
150	601808	中海油服	369,733	6,603,431.38	0.19
151	600196	复星医药	594,605	6,469,302.40	0.18
152	000729	燕京啤酒	377,923	6,413,353.31	0.18
153	000969	安泰科技	320,342	6,256,279.26	0.18
154	600598	北大荒	444,084	6,217,176.00	0.17
155	600970	中材国际	226,346	6,186,036.18	0.17
156	600376	首开股份	466,705	6,165,173.05	0.17
157	600997	开滦股份	385,500	6,152,580.00	0.17
158	600352	浙江龙盛	641,890	6,149,306.20	0.17
159	600169	太原重工	605,420	6,145,013.00	0.17
160	000839	中信国安	587,469	6,115,552.29	0.17
161	002007	华兰生物	179,915	6,106,315.10	0.17
162	000562	宏源证券	364,961	6,098,498.31	0.17
163	600631	百联股份	409,640	6,095,443.20	0.17
164	600125	铁龙物流	570,711	6,015,293.94	0.17
165	600208	新湖中宝	961,681	5,991,272.63	0.17
166	000625	长安汽车	652,360	5,969,094.00	0.17
167	600812	华北制药	513,796	5,918,929.92	0.17
168	600703	三安光电	360,740	5,916,136.00	0.17
169	600085	同仁堂	162,575	5,797,424.50	0.16
170	600649	城投控股	713,695	5,795,203.40	0.16
171	600316	洪都航空	179,085	5,771,909.55	0.16
172	600811	东方集团	832,690	5,728,907.20	0.16
173	600219	南山铝业	603,947	5,683,141.27	0.16
174	600809	山西汾酒	80,511	5,639,795.55	0.16
175	600582	天地科技	252,700	5,594,778.00	0.16
176	000728	国元证券	490,559	5,543,316.70	0.16
177	601866	中海集运	1,485,980	5,408,967.20	0.15
178	002128	露天煤业	248,505	5,404,983.75	0.15
179	601101	昊华能源	85,016	5,365,359.76	0.15
180	600418	江淮汽车	482,876	5,364,752.36	0.15
181	000061	农产品	335,977	5,362,192.92	0.15
182	600062	双鹤药业	214,203	5,310,092.37	0.15
183	002422	科伦药业	89,964	5,307,876.00	0.15
184	600216	浙江医药	168,660	5,294,237.40	0.15
185	600221	海南航空	738,240	5,271,033.60	0.15
186	600108	亚盛集团	867,736	5,267,157.52	0.15
187	600588	用友软件	254,828	5,264,746.48	0.15
188	600066	宇通客车	227,281	5,259,282.34	0.15
189	600516	方大炭素	399,404	5,244,174.52	0.15

190	600839	四川长虹	1,555,838	5,196,498.92	0.15
191	600808	马钢股份	1,490,616	5,187,343.68	0.15
192	000876	新希望	259,908	5,185,164.60	0.15
193	600018	上港集团	1,324,947	5,167,293.30	0.15
194	600331	宏达股份	386,620	5,145,912.20	0.14
195	601818	光大银行	1,529,900	5,125,165.00	0.14
196	000059	辽通化工	374,810	5,089,919.80	0.14
197	601179	中国西电	816,233	4,979,021.30	0.14
198	601158	重庆水务	599,500	4,951,870.00	0.14
199	600118	中国卫星	220,102	4,932,485.82	0.14
200	600879	航天电子	405,150	4,926,624.00	0.14
201	600601	方正科技	1,370,645	4,906,909.10	0.14
202	600635	大众公用	821,737	4,848,248.30	0.14
203	600779	水井坊	213,564	4,788,104.88	0.13
204	000807	云铝股份	443,568	4,772,791.68	0.13
205	600595	中孚实业	473,039	4,749,311.56	0.13
206	002092	中泰化学	360,450	4,729,104.00	0.13
207	600239	云南城投	359,914	4,628,494.04	0.13
208	600325	华发股份	408,123	4,579,140.06	0.13
209	600895	张江高科	483,567	4,564,872.48	0.13
210	002146	荣盛发展	465,513	4,562,027.40	0.13
211	600432	吉恩镍业	202,650	4,515,042.00	0.13
212	600500	中化国际	448,880	4,484,311.20	0.13
213	600508	上海能源	180,540	4,399,759.80	0.12
214	000652	泰达股份	572,820	4,399,257.60	0.12
215	000999	华润三九	244,537	4,389,439.15	0.12
216	600546	山煤国际	140,500	4,382,195.00	0.12
217	600210	紫江企业	717,740	4,306,440.00	0.12
218	600717	天津港	522,919	4,277,477.42	0.12
219	601918	国投新集	346,640	4,215,142.40	0.12
220	600675	中华企业	618,252	4,204,113.60	0.12
221	600266	北京城建	277,660	4,178,783.00	0.12
222	600312	平高电气	409,175	4,153,126.25	0.12
223	000968	煤气化	160,420	4,063,438.60	0.11
224	600170	上海建工	260,248	4,057,266.32	0.11
225	600037	歌华有线	397,310	4,048,588.90	0.11
226	000780	平庄能源	253,398	4,029,028.20	0.11
227	600528	中铁二局	455,580	3,958,990.20	0.11
228	600804	鹏博士	501,542	3,957,166.38	0.11
229	600220	江苏阳光	779,520	3,928,780.80	0.11
230	600008	首创股份	686,878	3,887,729.48	0.11

231	601888	中国国旅	164,144	3,878,722.72	0.11
232	600456	宝钛股份	134,300	3,875,898.00	0.11
233	002399	海普瑞	99,890	3,866,741.90	0.11
234	600428	中远航运	527,791	3,810,651.02	0.11
235	002122	天马股份	296,720	3,798,016.00	0.11
236	000690	宝新能源	754,732	3,788,754.64	0.11
237	000046	泛海建设	426,845	3,747,699.10	0.11
238	000612	焦作万方	209,900	3,744,616.00	0.11
239	000027	深圳能源	495,091	3,732,986.14	0.10
240	600481	双良节能	252,900	3,656,934.00	0.10
241	600663	陆家嘴	254,421	3,556,805.58	0.10
242	600893	航空动力	204,110	3,529,061.90	0.10
243	600674	川投能源	241,789	3,467,254.26	0.10
244	600096	云天化	173,305	3,447,036.45	0.10
245	600269	赣粤高速	729,202	3,434,541.42	0.10
246	000959	首钢股份	773,655	3,419,555.10	0.10
247	600017	日照港	821,340	3,416,774.40	0.10
248	000021	长城开发	411,968	3,411,095.04	0.10
249	000718	苏宁环球	425,348	3,402,784.00	0.10
250	000667	名流置业	1,118,817	3,345,262.83	0.09
251	000951	中国重汽	180,647	3,338,356.56	0.09
252	600026	中海发展	395,022	3,333,985.68	0.09
253	600863	内蒙华电	371,166	3,288,530.76	0.09
254	000031	中粮地产	566,294	3,239,201.68	0.09
255	600737	中粮屯河	313,970	3,218,192.50	0.09
256	000686	东北证券	159,657	3,209,105.70	0.09
257	600823	世茂股份	219,275	3,207,993.25	0.09
258	600183	生益科技	341,820	3,137,907.60	0.09
259	600596	新安股份	296,871	3,123,082.92	0.09
260	002244	滨江集团	253,290	3,115,467.00	0.09
261	600087	长航油运	1,059,726	3,083,802.66	0.09
262	600380	健康元	329,066	3,030,697.86	0.09
263	600369	西南证券	239,865	2,847,197.55	0.08
264	000900	现代投资	174,440	2,843,372.00	0.08
265	600307	酒钢宏兴	511,020	2,800,389.60	0.08
266	600517	置信电气	231,803	2,797,862.21	0.08
267	600033	福建高速	856,853	2,776,203.72	0.08
268	600151	航天机电	239,154	2,757,445.62	0.08
269	600161	天坛生物	160,959	2,728,255.05	0.08
270	600109	国金证券	187,368	2,726,204.40	0.08
271	600300	维维股份	522,038	2,688,495.70	0.08

272	600611	大众交通	390,502	2,678,843.72	0.08
273	600718	东软集团	230,001	2,617,411.38	0.07
274	002415	海康威视	62,400	2,451,696.00	0.07
275	000961	中南建设	218,800	2,306,152.00	0.06
276	601268	二重重装	211,100	2,288,324.00	0.06
277	002294	信立泰	68,040	2,285,463.60	0.06
278	601107	四川成渝	405,200	2,277,224.00	0.06
279	600004	白云机场	287,238	2,266,307.82	0.06
280	002028	思源电气	164,768	2,255,673.92	0.06
281	601369	陕鼓动力	204,715	2,245,723.55	0.06
282	600006	东风汽车	499,580	2,188,160.40	0.06
283	601877	正泰电器	125,468	2,174,360.44	0.06
284	000927	一汽夏利	298,880	2,110,092.80	0.06
285	600597	光明乳业	262,054	2,078,088.22	0.06
286	600748	上实发展	270,620	1,959,288.80	0.06
287	002405	四维图新	59,991	1,868,719.65	0.05
288	600657	信达地产	285,513	1,818,717.81	0.05
289	002242	九阳股份	142,564	1,782,050.00	0.05
290	601099	太平洋	187,780	1,768,887.60	0.05
291	600350	山东高速	420,160	1,739,462.40	0.05
292	002385	大北农	50,010	1,620,324.00	0.05
293	601139	深圳燃气	153,643	1,610,178.64	0.05
294	601186	中国铁建	96,111	581,471.55	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	600036	招商银行	61,191,574.47	2.07
2	601228	农业银行	57,799,048.10	1.95
3	600000	浦发银行	53,619,353.19	1.81
4	600016	民生银行	45,939,927.97	1.55
5	600276	恒瑞医药	41,691,050.75	1.41
6	600030	中信证券	35,013,125.54	1.18
7	601318	中国平安	32,934,499.19	1.11
8	600015	华夏银行	27,508,611.36	0.93
9	601328	交通银行	25,661,161.25	0.87
10	000002	万科A	25,183,916.95	0.85

11	601166	兴业银行	24,267,574.87	0.82
12	600837	海通证券	23,893,280.41	0.81
13	601668	中国建筑	22,683,762.05	0.77
14	600887	伊利股份	21,854,983.25	0.74
15	601088	中国神华	19,393,653.75	0.66
16	600406	国电南瑞	15,671,546.79	0.53
17	601601	中国太保	15,451,143.05	0.52
18	000630	铜陵有色	15,142,289.55	0.51
19	601939	建设银行	14,877,595.41	0.50
20	600519	贵州茅台	14,383,843.47	0.49

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金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，卖出主要指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，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

7.4.2 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	61,471,859.23	2.08
2	600016	民生银行	35,222,365.07	1.19
3	600000	浦发银行	32,092,051.80	1.08
4	601939	建设银行	28,833,744.73	0.97
5	600276	恒瑞医药	27,539,991.87	0.93
6	600015	华夏银行	27,324,209.88	0.92
7	600837	海通证券	25,243,674.65	0.85
8	601318	中国平安	16,613,719.44	0.56
9	600085	同仁堂	16,076,402.43	0.54
10	601186	XD 中国铁	14,667,827.50	0.50
11	000630	铜陵有色	14,141,842.10	0.48
12	601328	交通银行	14,036,371.49	0.47
13	601166	兴业银行	13,042,309.51	0.44
14	600030	中信证券	12,503,430.95	0.42
15	600900	长江电力	11,248,257.50	0.38
16	000002	万科 A	10,994,515.48	0.37
17	601088	中国神华	10,404,260.02	0.35
18	601299	中国北车	10,041,947.62	0.34
19	000538	云南白药	10,008,796.71	0.34
20	600011	华能国际	9,321,740.75	0.32

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,621,292,565.33
卖出股票的收入（成交）总额	940,244,587.98

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	1,154,713.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,877,886.81
4	应收利息	52,767.97
5	应收申购款	3,407,225.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,492,593.44

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的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。

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
115,012	23,857.66	1,411,074,271.17	51.43%	1,332,843,068.64	48.57%

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	2,084,341.01	0.0760%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 12 月 30 日）基金份额总额	653,693,988.31
本报告期初基金份额总额	2,233,184,691.42
本报告期基金总申购份额	1,259,663,733.80
减：本报告期基金总赎回份额	748,931,085.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,743,917,339.81

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，基金管理人重大人事变动：

1. 董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满，原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前，代为履行董事长职责。代为履行职责的时间不得超过 90 日，法律、行政法规另有规定的除外。

2011 年 6 月 15 日，公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》，披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段，在其高管任职资格获准前，继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。2011 年 7 月 19 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1119 号）。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格，并对王志伟任我司董事长无异议。自 2011 年 7 月 19 日起，王志伟正式履行董事长职务。

2011 年 8 月 5 日，我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

2. 聘任副总经理

2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。

2011 年 8 月 11 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1267 号），中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格，并对易阳方任公司副总经理无异议。

自 2011 年 8 月 11 日起，易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内，基金托管人托管业务部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内本基金的基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	4	-	-	-	-	新增 3 个
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	143,572,590.75	5.63%	116,653.33	5.44%	新增 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
高华证券	1	62,670,836.25	2.46%	53,269.64	2.48%	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发华福	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	950,723,990.98	37.30%	805,217.81	37.53%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	244,446,856.73	9.59%	198,614.63	9.26%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
宏源证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	4	-	-	-	-	新增 1 个
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
南京证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
平安证券	3	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	209,295,975.00	8.21%	177,901.21	8.29%	新增 1 个
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
申银万国	2	-	-	-	-	新增 1 个
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	620,593,878.02	24.35%	527,505.59	24.58%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	90,468,762.58	3.55%	76,898.97	3.58%	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	1	226,877,364.06	8.90%	189,659.14	8.84%	-
中银国际	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）交易席位选择标准：

- （一）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （三）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的
的需要；
- （四）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、
行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- （五）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- （六）能提供其他基金运作和管理所需的服务。

（2）交易席位选择流程：

1、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。

2、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。

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	
	成交金额	占当期 债券成 交总额	成交金额	占当期回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额

		的比例				的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
广发证券	8,114,005.00	38.81%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	12,426,207.00	59.43%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	367,164.01	1.76%	1,049,000,000.00	100.00%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于增加财达证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
2	广发基金管理有限公司关于增加哈尔滨银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-14
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加海通证券基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-21
4	广发基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中信建投证券定期定额投资申购起点金额的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
5	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销（含定期定额投资）申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
6	广发基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行作为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》	2011-03-17
7	广发基金管理有限公司关于增加红塔证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《证券时报》	2011-03-17
8	广发基金关于旗下基金所持双汇发展（000895）估值调整的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-22
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加东莞银行网上银行及定期定额方式申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
10	广发基金管理有限公司关于参加中国工商	《中国证券报》、	2011-04-01

	银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金2011”网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-06
12	广发基金管理有限公司关于增加国金证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
13	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
14	广发基金管理有限公司关于增加浙江稠州商业银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
15	广发基金管理有限公司关于增加联讯证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-03
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券推出定期定额投资等业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-11
17	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加天津银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-23

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
2. 《广发沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
3. 《广发沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
4. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 《广发沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一一年八月二十九日