

# 广发沪深 300 指数证券投资基金

## 2012 年半年度报告

2012 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：二〇一二年八月二十七日

## 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 2012 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 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.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	47
11 备查文件目录.....	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

## 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	2,540,578,797.09份
基金合同存续期	不定期

### 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	赵会军

	联系电话	020-83936666	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	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-90,711,111.50
本期利润	111,442,189.70
加权平均基金份额本期利润	0.0448
本期加权平均净值利润率	4.06%
本期基金份额净值增长率	5.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-201,699,473.38
期末可供分配基金份额利润	-0.0794
期末基金资产净值	2,734,535,304.82

期末基金份额净值	1.076
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	31.66%

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	-5.36%	1.03%	-6.15%	1.04%	0.79%	-0.01%
过去三个月	1.41%	1.05%	0.27%	1.07%	1.14%	-0.02%
过去六个月	5.49%	1.24%	4.71%	1.26%	0.78%	-0.02%
过去一年	-17.04%	1.26%	-18.14%	1.28%	1.10%	-0.02%
过去三年	-20.64%	1.48%	-21.04%	1.49%	0.40%	-0.01%
自基金合同生效起至今	31.66%	1.53%	31.21%	1.55%	0.45%	-0.02%

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

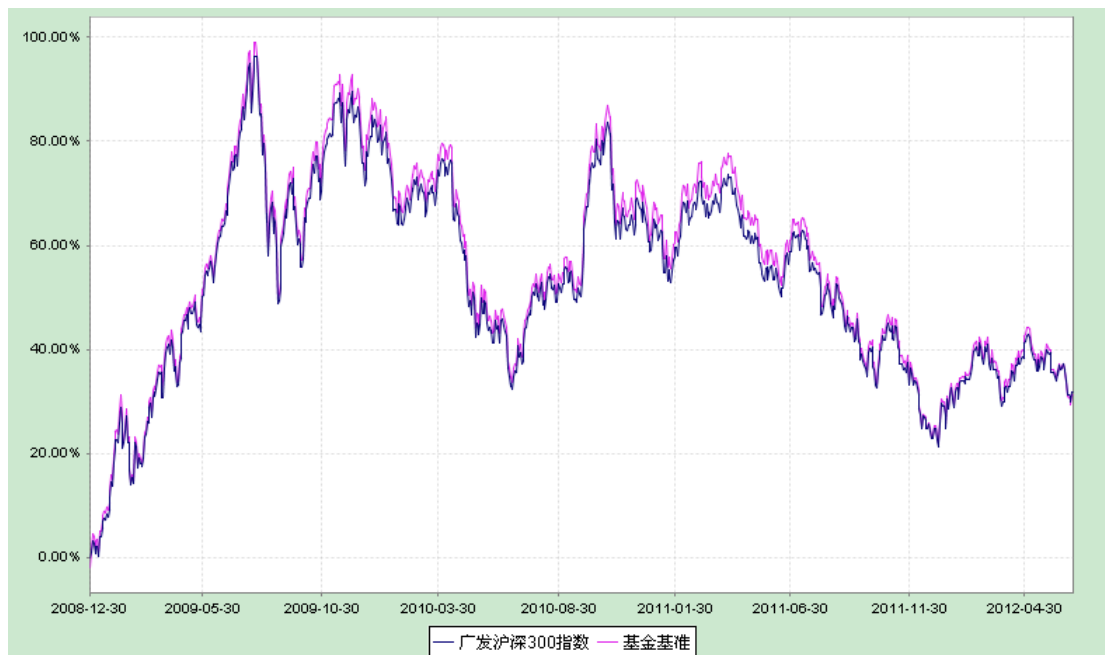
(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

#### 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 2012 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、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、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、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至2012年6月30日，本基金管理人管理二十四只开放式基金——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、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金和广发消费品精选股票型证券投资基金，管理资产规模为 1207.82 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 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	-	5	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。

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遵规守信情况的说明

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。监察稽核部风险控制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；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，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

##### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与其他投资组合发生的同日反向交易中，成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共有 7 次，原因是本投资组合调仓。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

#### **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 0.06%，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

本报告期基金份额净值增长率为 5.49%，业绩比较基准收益率为 4.71%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来经济形势不断下滑，以沪深 300 成份股为代表的传统行业面临较大的盈利恶化压力。但市场预期中央的经济政策会有较大力度的放松来对冲经济下滑的影响，目前来看这种预期在逐步兑现，如果经济增速进一步下降，不排除政府更采用更有力的手段来保增长。在此逻辑下，我们预计沪深 300 为代表的蓝筹股风险较小。

### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。本基金本期末可供分配利润为-201,699,473.38 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

2012 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

2012 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 2012 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	96,321,664.92	149,701,883.14
结算备付金		3,465,104.91	5,433,182.89
存出保证金		750,660.83	1,034,440.40
交易性金融资产	6.4.7.2	2,682,305,630.18	2,139,498,895.62
其中：股票投资		2,585,139,850.18	2,139,498,895.62
基金投资		-	-
债券投资		97,165,780.00	-
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		2,996,817.59	-
应收利息	6.4.7.5	2,113,020.34	36,058.27
应收股利		3,793,776.09	-
应收申购款		2,396,870.76	35,352,730.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,794,143,545.62	2,331,057,190.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	33,051,515.32
应付赎回款		55,888,606.71	1,458,212.82
应付管理人报酬		1,741,641.81	1,481,928.45
应付托管费		348,328.38	296,385.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,229,274.36	595,105.84

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	400,389.54	283,442.22
负债合计		59,608,240.80	37,166,590.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,540,578,797.09	2,249,758,850.75
未分配利润	6.4.7.10	193,956,507.73	44,131,749.60
所有者权益合计		2,734,535,304.82	2,293,890,600.35
负债和所有者权益总计		2,794,143,545.62	2,331,057,190.72

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 2,540,578,797.09 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>126,110,527.65</b>	<b>-91,401,680.65</b>
1.利息收入		1,561,061.14	843,630.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	448,901.06	646,605.76
债券利息收入		986,381.52	6,889.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		125,778.56	190,135.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-78,408,656.35	22,278,326.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-109,675,615.20	-8,710,421.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	198,700.55	-765,250.49
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	31,068,258.30	31,753,998.03
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	202,153,301.20	-115,672,373.56
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	804,821.66	1,148,736.21
<b>减: 二、费用</b>		<b>14,668,337.95</b>	<b>18,902,575.96</b>
1. 管理人报酬		10,198,555.42	12,598,652.50
2. 托管费		2,039,711.10	2,519,730.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,230,153.82	3,590,555.01
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	199,917.61	193,638.02
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>111,442,189.70</b>	<b>-110,304,256.61</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>111,442,189.70</b>	<b>-110,304,256.61</b>

### 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: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,249,758,850.75	44,131,749.60	2,293,890,600.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	111,442,189.70	111,442,189.70
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)	290,819,946.34	38,382,568.43	329,202,514.77
其中: 1. 基金申购款	1,066,536,393.07	119,931,399.82	1,186,467,792.89
2. 基金赎回款	-775,716,446.73	-81,548,831.39	-857,265,278.12
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,540,578,797.09	193,956,507.73	2,734,535,304.82

项目	上年度可比期间 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

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 2012 年 8 月 24 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **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，暂免予缴纳印花税、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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	96,321,664.92
定期存款	-
其他存款	-
合计	96,321,664.92

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		2,986,056,892.16	2,585,139,850.18	-400,917,041.98
债券	交易所市场	245,000.00	255,780.00	10,780.00
	银行间市场	96,673,400.00	96,910,000.00	236,600.00
	合计	96,918,400.00	97,165,780.00	247,380.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,082,975,292.16	2,682,305,630.18	-400,669,661.98

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	12,200.22
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	1,403.37
应收债券利息	2,099,416.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,113,020.34

#### 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 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,229,274.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,229,274.36

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	206,928.04
预提费用	193,461.50
合计	400,389.54

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,249,758,850.75	2,249,758,850.75
本期申购	1,066,536,393.07	1,066,536,393.07
本期赎回（以“-”号填列）	-775,716,446.73	-775,716,446.73
本期末	2,540,578,797.09	2,540,578,797.09

注：本期申购含转换转入份(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	-89,375,572.10	133,507,321.70	44,131,749.60
本期利润	-90,711,111.50	202,153,301.20	111,442,189.70
本期基金份额交易产生的变动数	-21,612,789.78	59,995,358.21	38,382,568.43
其中：基金申购款	-80,926,444.68	200,857,844.50	119,931,399.82
基金赎回款	59,313,654.90	-140,862,486.29	-81,548,831.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-201,699,473.38	395,655,981.11	193,956,507.73

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	24,543.48
其他	7,108.81
合计	448,901.06

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	649,880,688.98
减：卖出股票成本总额	759,556,304.18
买卖股票差价收入	-109,675,615.20

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,345,791.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,146,000.00
减：应收利息总额	1,090.45
债券投资收益	198,700.55

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	31,068,258.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,068,258.30

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	202,153,301.20
——股票投资	201,905,921.20
——债券投资	247,380.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	202,153,301.20

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	194,457.26
手续费返还	-

基金转换费收入	610,364.40
印花税返还	-
其他	-
合计	804,821.66

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,229,753.82
银行间市场交易费用	400.00
合计	2,230,153.82

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	4,956.11
账户维护费	6,000.00
合计	199,917.61

**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**

2012 年 8 月 1 日，广发基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议决议，将公司旗下基金年审会计师事务所由深圳市鹏城会计师事务所有限公司更换为天健会计师事务所(特殊普通合伙)。

**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。

**6.4.9.2 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	169,383,486.84	10.26%	950,723,990.98	37.30%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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%

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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 2012年1月1日至2012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	142,595.31	11.45%	34,974.03	2.85%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,198,555.42	12,598,652.50
其中: 支付销售机构的客户 维护费	1,068,130.08	1,331,992.17

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位: 人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	2,039,711.10	2,519,730.43

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

**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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

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

本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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	96,321,664.92	417,248.77	86,391,845.08	599,357.44

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 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
002500	山西证券	2012-05-15	重大事项	8.19	-	-	278,031	2,442,784.27	2,277,073.89	-

##### 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 2012 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 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。

本基金本报告期末持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券仅占基金资产净值的 0.01%，因此与债券相关的信用风险不重大。本基金上年度末未持有债券。

#### 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最大的风险，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 2012年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	96,321,664.92	-	-	-	96,321,664.92
结算备付金	3,465,104.91	-	-	-	3,465,104.91
存出保证金	-	-	-	750,660.83	750,660.83
交易性金融资产	97,165,780.00	-	-	2,585,139,850. 18	2,682,305,630. 18
应收证券清算款	-	-	-	2,996,817.59	2,996,817.59
应收利息	-	-	-	2,113,020.34	2,113,020.34
应收申购款	-	-	-	2,396,870.76	2,396,870.76
应收股利	-	-	-	3,793,776.09	3,793,776.09
资产总计	196,952,549.83	-	-	2,597,190,995. 79	2,794,143,545. 62
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,888,606.71	55,888,606.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,741,641.81	1,741,641.81
应付托管费	-	-	-	348,328.38	348,328.38
应付交易费用	-	-	-	1,229,274.36	1,229,274.36
其他负债	-	-	-	400,389.54	400,389.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	59,608,240.80	59,608,240.80
利率敏感度缺口	196,952,549.83	-	-	2,537,582,754. 99	2,734,535,304. 82
上年度末2011 年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	149,701,883.14	-	-	-	149,701,883.14
结算备付金	5,433,182.89	-	-	-	5,433,182.89
存出保证金	-	-	-	1,034,440.40	1,034,440.40
交易性金融资产	-	-	-	2,139,498,895.62	2,139,498,895.62
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	36,058.27	36,058.27
应收申购款	35,352,730.40	-	-	-	35,352,730.40
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	190,487,796.43	-	-	2,140,569,394.29	2,331,057,190.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,458,212.82	1,458,212.82
应付管理人报酬	-	-	-	1,481,928.45	1,481,928.45
应付托管费	-	-	-	296,385.72	296,385.72
应付交易费用	-	-	-	595,105.84	595,105.84
其他负债	-	-	-	283,442.22	283,442.22
应付证券清算款	-	-	-	33,051,515.32	33,051,515.32
负债总计	-	-	-	37,166,590.37	37,166,590.37
利率敏感度缺口	190,487,796.43	-	-	2,103,402,803.92	2,293,890,600.35

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：人民币元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	市场利率上升25个基点	-94,938.77	-
	市场利率下降25个基点	95,166.08	-

注：本基金上年度末未持有债券投资，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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	2,585,139,850.18	94.54	2,139,498,895.62	93.27
交易性金融资产-债券投资	97,165,780.00	3.55	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,682,305,630.18	98.09	2,139,498,895.62	93.27

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化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：人民币元）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	156,113,208.97	128,806,074.85
	业绩比较基准下降5%	-156,113,208.97	-128,806,074.85

#### 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	2,585,139,850.18	92.52
	其中：股票	2,585,139,850.18	92.52
2	固定收益投资	97,165,780.00	3.48
	其中：债券	97,165,780.00	3.48
	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	99,786,769.83	3.57
6	其他各项资产	12,051,145.61	0.43
7	合计	2,794,143,545.62	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	15,459,207.90	0.57
B	采掘业	265,831,727.32	9.72
C	制造业	901,673,590.94	32.97
C0	食品、饮料	188,609,657.49	6.90
C1	纺织、服装、皮毛	11,572,466.51	0.42
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	47,416,226.10	1.73
C5	电子	29,370,104.62	1.07
C6	金属、非金属	211,034,812.71	7.72
C7	机械、设备、仪表	291,652,984.72	10.67
C8	医药、生物制品	122,009,394.79	4.46
C99	其他制造业	7,944.00	0.00

D	电力、煤气及水的生产和供应业	74,180,160.80	2.71
E	建筑业	70,343,174.26	2.57
F	交通运输、仓储业	73,476,235.62	2.69
G	信息技术业	73,817,323.96	2.70
H	批发和零售贸易	55,255,953.90	2.02
I	金融、保险业	834,389,918.93	30.51
J	房地产业	146,951,557.33	5.37
K	社会服务业	22,764,214.72	0.83
L	传播与文化产业	5,406,287.70	0.20
M	综合类	45,590,496.80	1.67
	合计	2,585,139,850.18	94.54

### 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	601328	交通银行	21,701,740	98,525,899.60	3.60
2	601318	中国平安	1,820,158	83,254,026.92	3.04
3	600030	中信证券	6,229,845	78,682,942.35	2.88
4	600016	民生银行	12,270,799	73,502,086.01	2.69
5	600036	招商银行	6,718,058	73,361,193.36	2.68
6	600519	贵州茅台	225,614	53,955,588.10	1.97
7	601166	兴业银行	4,101,823	53,241,662.54	1.95
8	600000	浦发银行	6,089,911	49,510,976.43	1.81
9	000002	万科A	5,296,739	47,193,944.49	1.73
10	600837	海通证券	4,391,146	42,286,735.98	1.55
11	601088	中国神华	1,791,828	40,280,293.44	1.47
12	601601	中国太保	1,707,646	37,875,588.28	1.39
13	000858	五粮液	1,031,065	33,777,689.40	1.24
14	601288	农业银行	11,113,048	28,782,794.32	1.05
15	600111	包钢稀土	709,393	27,992,647.78	1.02
16	601668	中国建筑	8,148,810	27,217,025.40	1.00
17	600048	保利地产	2,326,595	26,383,587.30	0.96
18	000157	中联重科	2,386,608	23,937,678.24	0.88
19	000651	格力电器	1,143,799	23,848,209.15	0.87
20	601169	北京银行	2,390,304	23,353,270.08	0.85
21	600031	三一重工	1,650,123	22,969,712.16	0.84
22	601006	大秦铁路	3,230,602	22,711,132.06	0.83
23	000538	云南白药	373,971	22,169,000.88	0.81

24	002304	洋河股份	163,424	21,988,699.20	0.80
25	601939	建设银行	5,211,805	21,889,581.00	0.80
26	000001	深发展 A	1,391,624	21,097,019.84	0.77
27	002024	苏宁电器	2,280,501	19,133,403.39	0.70
28	601818	光大银行	6,589,915	18,715,358.60	0.68
29	600900	长江电力	2,689,050	18,285,540.00	0.67
30	600887	伊利股份	868,514	17,874,018.12	0.65
31	600015	华夏银行	1,860,630	17,620,166.10	0.64
32	601857	中国石油	1,928,469	17,452,644.45	0.64
33	600050	中国联通	4,606,041	17,134,472.52	0.63
34	601899	紫金矿业	4,292,728	16,655,784.64	0.61
35	600585	海螺水泥	1,086,423	16,100,788.86	0.59
36	000568	泸州老窖	378,721	16,023,685.51	0.59
37	600383	金地集团	2,429,200	15,741,216.00	0.58
38	600104	上汽集团	1,081,033	15,447,961.57	0.56
39	600256	广汇能源	1,137,587	15,323,296.89	0.56
40	000063	中兴通讯	1,068,739	14,919,596.44	0.55
41	601628	中国人寿	814,901	14,912,688.30	0.55
42	600999	招商证券	1,266,053	14,698,875.33	0.54
43	600028	中国石化	2,326,054	14,654,140.20	0.54
44	000983	西山煤电	855,950	13,352,820.00	0.49
45	600547	山东黄金	386,471	12,691,707.64	0.46
46	000069	华侨城 A	1,975,158	12,601,508.04	0.46
47	601989	中国重工	2,390,540	12,406,902.60	0.45
48	600019	宝钢股份	2,853,974	12,329,167.68	0.45
49	000338	潍柴动力	411,103	12,205,648.07	0.45
50	000527	美的电器	1,103,056	12,188,768.80	0.45
51	000792	盐湖股份	345,646	11,672,465.42	0.43
52	600489	中金黄金	532,982	11,469,772.64	0.42
53	000423	东阿阿胶	284,263	11,373,362.63	0.42
54	600795	国电电力	4,181,627	11,290,392.90	0.41
55	600362	江西铜业	451,034	10,784,222.94	0.39
56	601988	中国银行	3,685,918	10,394,288.76	0.38
57	601699	潞安环能	500,091	10,371,887.34	0.38
58	000629	攀钢钒钛	1,570,642	10,334,824.36	0.38
59	000895	双汇发展	165,977	10,270,656.76	0.38
60	600690	青岛海尔	875,221	10,257,590.12	0.38
61	600348	阳泉煤业	653,237	9,994,526.10	0.37
62	601788	光大证券	742,726	9,781,701.42	0.36
63	600089	特变电工	1,443,815	9,774,627.55	0.36
64	600276	恒瑞医药	335,909	9,643,947.39	0.35



65	601600	中国铝业	1,561,362	9,633,603.54	0.35
66	601009	南京银行	1,128,963	9,618,764.76	0.35
67	600406	国电南瑞	513,667	9,600,436.23	0.35
68	600011	华能国际	1,486,200	9,585,990.00	0.35
69	601688	华泰证券	912,655	9,582,877.50	0.35
70	600535	天士力	210,423	9,199,693.56	0.34
71	000024	招商地产	374,285	9,181,211.05	0.34
72	601299	中国北车	2,242,599	8,992,821.99	0.33
73	601168	西部矿业	1,035,705	8,865,634.80	0.32
74	601766	中国南车	1,919,665	8,753,672.40	0.32
75	000402	金融街	1,315,634	8,591,090.02	0.31
76	000783	长江证券	901,722	8,205,670.20	0.30
77	000709	河北钢铁	2,884,291	7,874,114.43	0.29
78	600309	烟台万华	587,370	7,841,389.50	0.29
79	601898	中煤能源	994,363	7,696,369.62	0.28
80	000100	TCL 集团	3,683,796	7,478,105.88	0.27
81	000630	铜陵有色	386,172	7,453,119.60	0.27
82	601186	中国铁建	1,672,340	7,441,913.00	0.27
83	600068	葛洲坝	1,136,791	7,423,245.23	0.27
84	600100	同方股份	863,810	7,273,280.20	0.27
85	600600	青岛啤酒	189,052	7,219,895.88	0.26
86	600642	申能股份	1,553,295	7,160,689.95	0.26
87	601390	中国中铁	2,785,640	7,159,094.80	0.26
88	000878	云南铜业	384,696	6,886,058.40	0.25
89	600150	中国船舶	299,509	6,879,721.73	0.25
90	600010	宝钢股份	1,398,263	6,823,523.44	0.25
91	000060	中金岭南	784,465	6,762,088.30	0.25
92	600009	上海机场	523,403	6,668,154.22	0.24
93	601958	金钼股份	525,851	6,662,532.17	0.24
94	600660	福耀玻璃	842,500	6,588,350.00	0.24
95	601618	中国中冶	2,646,518	6,563,364.64	0.24
96	600549	厦门钨业	148,208	6,507,813.28	0.24
97	601666	平煤股份	641,346	6,490,421.52	0.24
98	600583	海油工程	1,056,468	6,433,890.12	0.24
99	000425	徐工机械	448,267	6,428,148.78	0.24
100	000012	南玻 A	713,065	6,417,585.00	0.23
101	600196	复星医药	620,805	6,400,499.55	0.23
102	600123	兰花科创	351,546	6,348,920.76	0.23
103	600875	东方电气	349,912	6,270,423.04	0.23
104	000039	中集集团	468,512	6,231,209.60	0.23
105	601117	中国化学	1,071,926	6,185,013.02	0.23

106	600085	同仁堂	353,708	6,172,204.60	0.23
107	600177	雅戈尔	725,787	6,161,931.63	0.23
108	601991	大唐发电	1,085,896	6,113,594.48	0.22
109	600188	兖州煤业	321,571	6,103,417.58	0.22
110	002422	科伦药业	130,359	6,082,550.94	0.22
111	600143	金发科技	1,005,511	6,002,900.67	0.22
112	601998	中信银行	1,495,226	5,980,904.00	0.22
113	000009	中国宝安	592,610	5,926,100.00	0.22
114	600005	武钢股份	2,193,376	5,900,181.44	0.22
115	000581	威孚高科	214,980	5,890,452.00	0.22
116	002415	海康威视	216,482	5,888,310.40	0.22
117	000728	国元证券	533,564	5,821,183.24	0.21
118	601919	中国远洋	1,244,431	5,774,159.84	0.21
119	600415	小商品城	739,316	5,766,664.80	0.21
120	000937	冀中能源	376,930	5,755,721.10	0.21
121	600066	宇通客车	256,104	5,752,095.84	0.21
122	600166	福田汽车	802,329	5,736,652.35	0.21
123	600369	西南证券	504,673	5,707,851.63	0.21
124	600271	航天信息	300,934	5,690,661.94	0.21
125	600881	亚泰集团	1,029,356	5,661,458.00	0.21
126	002155	辰州矿业	291,663	5,646,595.68	0.21
127	601111	中国国航	911,685	5,606,862.75	0.21
128	600376	首开股份	405,946	5,374,725.04	0.20
129	002202	金风科技	834,582	5,349,670.62	0.20
130	600694	大商股份	159,609	5,338,921.05	0.20
131	601808	中海油服	322,309	5,321,321.59	0.19
132	600809	山西汾酒	141,155	5,320,131.95	0.19
133	600115	东方航空	1,268,306	5,301,519.08	0.19
134	600029	南方航空	1,146,763	5,286,577.43	0.19
135	000768	西飞国际	672,982	5,282,908.70	0.19
136	000562	宏源证券	317,532	5,251,979.28	0.19
137	600153	建发股份	729,416	5,222,618.56	0.19
138	600058	五矿发展	232,970	5,202,220.10	0.19
139	600252	中恒集团	474,489	5,200,399.44	0.19
140	000401	冀东水泥	365,981	5,145,692.86	0.19
141	600741	华域汽车	561,325	5,035,085.25	0.18
142	000625	长安汽车	1,029,086	5,021,939.68	0.18
143	600497	驰宏锌锗	355,857	5,006,907.99	0.18
144	000729	燕京啤酒	685,216	5,002,076.80	0.18
145	000933	神火股份	547,572	4,993,856.64	0.18
146	600655	豫园商城	624,620	4,922,005.60	0.18

147	601727	上海电气	1,070,313	4,880,627.28	0.18
148	000960	锡业股份	246,247	4,851,065.90	0.18
149	600395	盘江股份	179,888	4,835,389.44	0.18
150	000800	一汽轿车	442,073	4,800,912.78	0.18
151	000422	湖北宜化	390,318	4,781,395.50	0.17
152	000758	中色股份	249,870	4,740,033.90	0.17
153	000999	华润三九	212,742	4,648,412.70	0.17
154	600832	东方明珠	865,459	4,647,514.83	0.17
155	002106	莱宝高科	228,320	4,582,382.40	0.17
156	000528	柳 工	366,752	4,551,392.32	0.17
157	601333	广深铁路	1,535,322	4,513,846.68	0.17
158	600779	水井坊	185,799	4,509,341.73	0.16
159	600649	城投控股	624,280	4,507,301.60	0.16
160	601106	中国一重	1,420,753	4,489,579.48	0.16
161	600259	广晟有色	67,717	4,464,581.81	0.16
162	601607	上海医药	417,884	4,458,822.28	0.16
163	601717	郑煤机	380,294	4,411,410.40	0.16
164	000825	太钢不锈	1,237,842	4,369,582.26	0.16
165	600804	鹏博士	733,240	4,355,445.60	0.16
166	600703	三安光电	313,753	4,270,178.33	0.16
167	600219	南山铝业	636,578	4,265,072.60	0.16
168	002385	大北农	219,816	4,264,430.40	0.16
169	000876	新 希 望	283,252	4,243,114.96	0.16
170	600839	四川长虹	2,006,273	4,233,236.03	0.15
171	600125	铁龙物流	496,453	4,209,921.44	0.15
172	600208	新湖中宝	1,012,249	4,180,588.37	0.15
173	002001	新 和 成	197,199	4,166,814.87	0.15
174	600588	用友软件	265,919	4,057,923.94	0.15
175	600320	振华重工	959,538	4,049,250.36	0.15
176	601566	九牧王	145,000	4,038,250.00	0.15
177	002038	双鹭药业	124,117	3,996,567.40	0.15
178	600267	海正药业	228,175	3,988,499.00	0.15
179	601001	大同煤业	363,737	3,982,920.15	0.15
180	601888	中国国旅	140,953	3,977,693.66	0.15
181	600811	东方集团	724,383	3,969,618.84	0.15
182	000898	鞍钢股份	1,002,163	3,908,435.70	0.14
183	600372	中航电子	214,315	3,855,526.85	0.14
184	600893	航空动力	296,032	3,851,376.32	0.14
185	002007	华兰生物	156,536	3,847,654.88	0.14
186	002092	中泰化学	501,714	3,838,112.10	0.14
187	601179	中国西电	946,832	3,768,391.36	0.14

188	601101	昊华能源	217,285	3,719,919.20	0.14
189	600674	川投能源	535,858	3,708,137.36	0.14
190	600216	浙江医药	146,667	3,688,675.05	0.13
191	601918	国投新集	301,577	3,682,255.17	0.13
192	600266	北京城建	241,509	3,668,521.71	0.13
193	600108	亚盛集团	741,815	3,657,147.95	0.13
194	600331	宏达股份	448,433	3,605,401.32	0.13
195	600895	张江高科	420,651	3,604,979.07	0.13
196	000061	农产品	617,930	3,583,994.00	0.13
197	600062	华润双鹤	186,401	3,556,531.08	0.13
198	601018	宁波港	1,393,483	3,525,511.99	0.13
199	600997	开滦股份	336,301	3,521,071.47	0.13
200	000778	新兴铸管	520,701	3,483,489.69	0.13
201	000718	苏宁环球	429,658	3,480,229.80	0.13
202	600718	东软集团	400,089	3,444,766.29	0.13
203	600859	王府井	125,731	3,440,000.16	0.13
204	000969	安泰科技	281,231	3,439,455.13	0.13
205	000839	中信国安	511,033	3,434,141.76	0.13
206	600664	哈药股份	520,915	3,432,829.85	0.13
207	000046	泛海建设	750,000	3,352,500.00	0.12
208	600635	大众公用	714,927	3,331,559.82	0.12
209	600863	内蒙华电	420,669	3,323,285.10	0.12
210	002146	荣盛发展	303,703	3,310,362.70	0.12
211	601866	中海集运	1,292,771	3,270,710.63	0.12
212	600550	天威保变	372,999	3,256,281.27	0.12
213	601099	太平洋	467,209	3,223,742.10	0.12
214	002069	獐子岛	154,583	3,223,055.55	0.12
215	600352	浙江龙盛	558,425	3,199,775.25	0.12
216	600582	天地科技	219,849	3,176,818.05	0.12
217	600118	中国卫星	248,957	3,134,368.63	0.11
218	600221	海南航空	642,219	3,134,028.72	0.11
219	601158	重庆水务	521,476	3,071,493.64	0.11
220	601558	华锐风电	436,812	3,062,052.12	0.11
221	600316	洪都航空	233,816	3,046,622.48	0.11
222	600516	方大炭素	347,402	2,966,813.08	0.11
223	000807	云铝股份	501,725	2,955,160.25	0.11
224	601118	海南橡胶	427,159	2,934,582.33	0.11
225	600432	吉恩镍业	220,339	2,926,101.92	0.11
226	000680	山推股份	494,996	2,895,726.60	0.11
227	002299	圣农发展	197,983	2,858,874.52	0.10
228	600508	上海能源	157,014	2,846,663.82	0.10

229	600812	华北制药	447,049	2,843,231.64	0.10
230	002128	露天煤业	216,275	2,828,877.00	0.10
231	601098	中南传媒	292,647	2,803,558.26	0.10
232	000027	深圳能源	430,757	2,786,997.79	0.10
233	600598	北大荒	373,899	2,785,547.55	0.10
234	600879	航天电子	352,497	2,777,676.36	0.10
235	600808	马钢股份	1,296,799	2,775,149.86	0.10
236	600169	太原重工	790,134	2,773,370.34	0.10
237	600770	综艺股份	239,968	2,754,832.64	0.10
238	600008	首创股份	562,786	2,752,023.54	0.10
239	600970	中材国际	237,648	2,742,457.92	0.10
240	600315	上海家化	70,000	2,730,700.00	0.10
241	600170	上海建工	376,938	2,721,492.36	0.10
242	002073	软控股份	322,647	2,703,781.86	0.10
243	600528	中铁二局	396,348	2,679,312.48	0.10
244	600418	江淮汽车	490,074	2,651,300.34	0.10
245	600500	中化国际	390,535	2,640,016.60	0.10
246	600037	歌华有线	345,648	2,602,729.44	0.10
247	000059	辽通化工	326,108	2,579,514.28	0.09
248	601377	兴业证券	239,013	2,504,856.24	0.09
249	000869	张裕 A	36,827	2,476,984.02	0.09
250	601369	陕鼓动力	267,139	2,473,707.14	0.09
251	002344	海宁皮城	91,298	2,381,051.84	0.09
252	000686	东北证券	138,915	2,381,003.10	0.09
253	000961	中南建设	190,387	2,372,222.02	0.09
254	600109	国金证券	163,093	2,346,908.27	0.09
255	600098	广州控股	337,229	2,333,624.68	0.09
256	000780	平庄能源	220,423	2,310,033.04	0.08
257	600595	中孚实业	411,522	2,296,292.76	0.08
258	002500	山西证券	278,031	2,277,073.89	0.08
259	600971	恒源煤电	162,959	2,270,018.87	0.08
260	601992	金隅股份	340,981	2,267,523.65	0.08
261	601933	永辉超市	83,394	2,259,977.40	0.08
262	600546	山煤国际	107,679	2,252,644.68	0.08
263	600456	宝钛股份	116,896	2,194,137.92	0.08
264	000559	万向钱潮	432,794	2,176,953.82	0.08
265	002431	棕榈园林	83,412	2,151,195.48	0.08
266	000968	煤气化	139,551	2,128,152.75	0.08
267	002122	天马股份	322,731	2,084,842.26	0.08
268	600161	天坛生物	140,017	1,998,042.59	0.07
269	601718	际华集团	628,584	1,986,325.44	0.07

270	600783	鲁信创投	121,324	1,936,331.04	0.07
271	000021	长城开发	358,359	1,927,971.42	0.07
272	600096	云天化	144,283	1,913,192.58	0.07
273	002310	东方园林	31,883	1,871,850.93	0.07
274	600428	中远航运	459,234	1,869,082.38	0.07
275	002493	荣盛石化	120,917	1,853,657.61	0.07
276	002399	海普瑞	86,971	1,843,785.20	0.07
277	600183	生益科技	347,733	1,790,824.95	0.07
278	600151	航天机电	260,068	1,682,639.96	0.06
279	002603	以岭药业	60,079	1,655,176.45	0.06
280	600380	健康元	335,929	1,642,692.81	0.06
281	600737	中粮屯河	273,122	1,627,807.12	0.06
282	600026	中海发展	317,768	1,604,728.40	0.06
283	600307	酒钢宏兴	448,270	1,555,496.90	0.06
284	002405	四维图新	125,248	1,495,461.12	0.05
285	002378	章源钨业	46,567	1,474,311.22	0.05
286	601233	桐昆股份	157,012	1,372,284.88	0.05
287	600481	双良节能	176,054	1,260,546.64	0.05
288	002244	滨江集团	129,028	1,170,283.96	0.04
289	601258	庞大集团	185,532	1,131,745.20	0.04
290	002241	歌尔声学	30,887	1,127,066.63	0.04
291	601268	二重重装	183,604	1,125,492.52	0.04
292	601216	内蒙君正	139,357	971,318.29	0.04
293	002498	汉缆股份	77,931	828,406.53	0.03
294	601519	大智慧	151,439	782,939.63	0.03
295	601633	长城汽车	20,000	356,000.00	0.01
296	600132	重庆啤酒	1,631	35,213.29	0.00
297	600160	巨化股份	3,149	31,804.90	0.00
298	600873	梅花集团	3,011	20,324.25	0.00
299	002594	比亚迪	400	7,944.00	0.00
300	002142	宁波银行	25	249.50	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	601328	交通银行	64,672,023.46	2.82
2	000002	万科A	29,847,574.18	1.30

3	600383	金地集团	26,296,891.93	1.15
4	600030	中信证券	23,531,727.69	1.03
5	600036	招商银行	22,940,163.62	1.00
6	600016	民生银行	22,013,271.33	0.96
7	601318	中国平安	19,347,081.64	0.84
8	601818	光大银行	16,887,288.15	0.74
9	600031	三一重工	15,903,252.83	0.69
10	601166	兴业银行	15,629,717.63	0.68
11	600000	浦发银行	15,450,008.90	0.67
12	600048	保利地产	14,812,595.90	0.65
13	601288	农业银行	14,454,221.00	0.63
14	600104	上汽集团	13,884,680.20	0.61
15	000538	云南白药	13,866,221.47	0.60
16	601088	中国神华	13,309,569.21	0.58
17	600519	贵州茅台	13,084,838.00	0.57
18	000629	攀钢钒钛	11,321,499.03	0.49
19	600256	广汇能源	11,091,430.47	0.48
20	600837	海通证券	10,605,515.99	0.46

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	600015	华夏银行	33,124,519.47	1.44
2	000002	万科A	27,254,161.89	1.19
3	600383	金地集团	25,214,224.96	1.10
4	600030	中信证券	18,748,631.25	0.82
5	601328	交通银行	16,403,829.51	0.72
6	600036	招商银行	15,565,283.10	0.68
7	600016	民生银行	14,884,610.98	0.65
8	601318	中国平安	13,179,843.69	0.57
9	600048	保利地产	12,819,685.59	0.56
10	601166	兴业银行	10,619,735.25	0.46
11	600000	浦发银行	10,359,509.91	0.45
12	601088	中国神华	8,894,946.36	0.39
13	600519	贵州茅台	8,833,633.17	0.39
14	600111	包钢稀土	7,922,451.51	0.35

15	600837	海通证券	7,795,819.23	0.34
16	600256	广汇能源	7,690,524.65	0.34
17	601601	中国太保	6,804,344.99	0.30
18	000858	五 粮 液	6,227,506.30	0.27
19	002304	洋河股份	5,605,216.54	0.24
20	002142	宁波银行	5,375,176.39	0.23

#### 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	1,003,291,337.54
卖出股票的收入（成交）总额	649,880,688.98

#### 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	-	-
2	央行票据	96,910,000.00	3.54
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	255,780.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	97,165,780.00	3.55

#### 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	1101088	11 央行票据 88	1,000,000	96,910,000.00	3.54
2	113003	重工转债	2,450	255,780.00	0.01

#### 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	750,660.83
2	应收证券清算款	2,996,817.59
3	应收股利	3,793,776.09
4	应收利息	2,113,020.34
5	应收申购款	2,396,870.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,051,145.61

#### 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	持有份额	占总份额

			例		比例
114,790	22,132.41	1,017,164,059.67	40.04%	1,523,414,737.42	59.96%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	1,104,774.39	0.0435%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 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
本报告期期初基金份额总额	2,249,758,850.75
本报告期基金总申购份额	1,066,536,393.07
减：本报告期基金总赎回份额	775,716,446.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,540,578,797.09

## 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、基金托管人的专门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，因业务发展需要，广发基金管理有限公司第四届董事会第九次会议通过关于聘请 2012 年度基金审计机构的议案，本基金改聘深圳市鹏城会计师事务所有限公司负责本基金审计事务；因深圳市鹏城会计师事务所有限公司广州分公司已整体并入天健会计师事务所（特殊普通合伙），2012 年 8 月，本基金改聘天健会计师事务所（特殊普通合伙）负责本基金审计事务。

#### 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	
宏源证券	3	422,428,685.43	25.60%	274,578.42	22.06%	-
长江证券	2	231,446,458.44	14.02%	196,729.88	15.80%	-
广发证券	6	169,383,486.84	10.26%	142,595.31	11.45%	-
联讯证券	1	142,015,736.82	8.61%	123,104.09	9.89%	-
银河证券	3	117,042,829.04	7.09%	95,098.17	7.64%	-
华创证券	1	104,315,621.03	6.32%	88,668.70	7.12%	-
中信证券	3	95,533,763.70	5.79%	81,203.68	6.52%	-
华融证券	1	90,394,705.67	5.48%	55,366.78	4.45%	-
平安证券	4	88,368,589.13	5.35%	54,125.98	4.35%	-
东北证券	1	87,230,102.42	5.29%	56,699.16	4.55%	-
东方证券	2	27,303,831.29	1.65%	22,184.55	1.78%	-

国信证券	4	24,516,322.29	1.49%	19,919.71	1.60%	-
安信证券	4	22,664,443.18	1.37%	14,675.51	1.18%	-
民生证券	1	14,966,916.17	0.91%	9,691.15	0.78%	-
中信建投	4	12,640,222.85	0.77%	10,270.21	0.82%	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	新增 1个
光大证券	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券(浙江)	1	-	-	-	-	新增 1 个
财富证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
红塔证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1.交易席位选择标准：

- (1)财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2)经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3)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  
需要；
- (4)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；
- (5)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；
- (6)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 的比例	成交金额	占当期回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
宏源证券	-	-	689,000,000.00	70.38%	-	-
长江证券	-	-	30,000,000.00	3.06%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	4,345,791.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	210,000,000.00	21.45%	-	-
中信证券	-	-	50,000,000.00	5.11%	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(浙江)	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下基金参加浙商银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-04
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加华夏银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-04
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续参加深圳发展银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-04
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金继续	《中国证券报》、	2012-01-04

	参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》	
5	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞银行基金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》	2012-01-09
6	广发基金管理有限公司关于广发基金旗下基金所持深发展A（000001）估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-19
7	广发基金管理有限公司关于平安银行调整我司部分基金申购和基金定期定额申购费率的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-01-20
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加顺德农商银行为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-02-08
9	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》	2012-02-29
10	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销业务申购起点金额和最低持有份额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-03-20
11	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-14
12	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中天证券推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-14
13	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行等电子渠道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》	2012-06-29
14	广发基金管理有限公司关于网上交易系统开通广发中证500指数等旗下指数基金的后端收费模式的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2012-06-29

## 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](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十七日