

鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 29 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 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 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的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	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.....	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.....	40
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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43

§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
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 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	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.....	46
§11 备查文件目录.....	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)
基金主代码	160615
交易代码	160615
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	856,138,026.53 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009 年 5 月 8 日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行同业存款利率 \times 5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人 姓名	张戈	赵会军

	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	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.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-17,961,185.22
本期利润	25,596,417.28
加权平均基金份额本期利润	0.0327
本期加权平均净值利润率	3.61%
本期基金份额净值增长率	5.63%
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	-100,932,807.61
期末可供分配基金份额利润	-0.1179
期末基金资产净值	755,205,218.92
期末基金份额净值	0.882

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-7.56%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

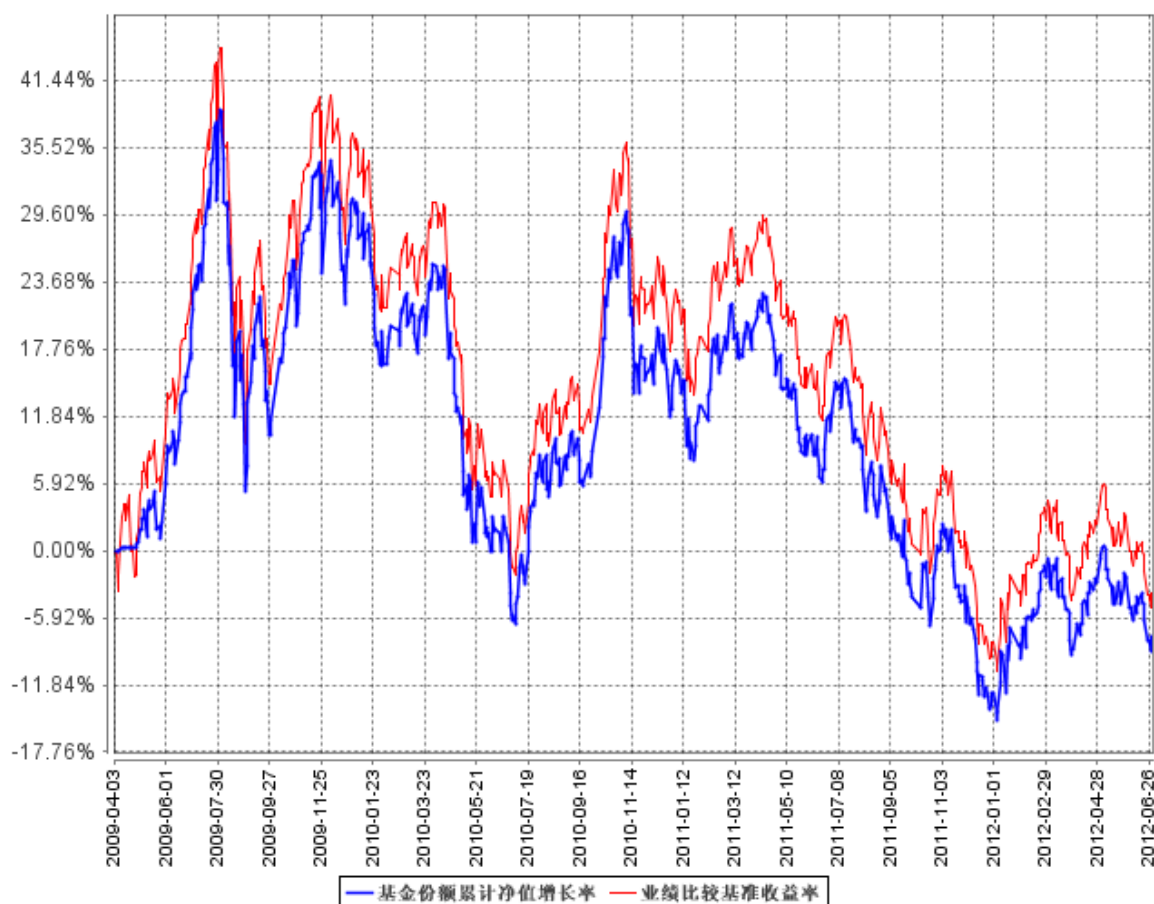
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.26%	1.03%	-6.15%	1.04%	0.89%	-0.01%
过去三个月	1.26%	1.05%	0.29%	1.07%	0.97%	-0.02%
过去六个月	5.63%	1.25%	4.76%	1.26%	0.87%	-0.01%
过去一年	-17.57%	1.28%	-18.16%	1.28%	0.59%	0.00%
过去三年	-20.99%	1.49%	-20.85%	1.49%	-0.14%	0.00%
自基金合同生效起至今	-7.56%	1.46%	-3.68%	1.49%	-3.88%	-0.03%

注：基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、鹏华沪深 300 指数（LOF）基金合同于 2009 年 4 月 3 日生效。

2、按基金合同规定，截至建仓期结束本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§ 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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 2 只封闭式基金、27 只开放式基金和 6 只社保组合，经过 13 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨靖	本基金基金经理	2009年4月3日	-	12	杨靖，国籍中国，管理学硕士，12年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作，先后任研究员、行业研究小组组长；2001年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，2005年开始先后任鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华行业成长证券投资基金基金经理助理，2006年8月至2007年4月任原鹏华普润基金（2007年4月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF））基金经理，2007年4月至2009年10月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2009年4月3日起至今担任鹏华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理。杨靖先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金运作合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格执行公平交易制度, 确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金未发生违法违规且并对基金财产造成损失的异常交易行为, 未存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

沪深 300 指数 2012 年上半年呈现冲高回落的震荡走势。影响市场的正面因素包括: 市场整体估值较低下行空间有限、CPI 逐月下行打开了宏观经济政策调整的空间、经济实体的流动性改善也缓解了市场资金面偏紧的压力; 负面因素包括: 外围经济特别是欧债危机持续动荡、国内上市公司盈利下降的预期增强、IPO 节奏加快加剧市场供大于求的预期。

上半年, 本基金大额申购赎回较多, 基金份额的频繁变动, 给跟踪指数造成一定干扰, 但经过精心操作, 本基金的跟踪误差仍控制在较低的水平。

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 0.882 元, 累计净值 0.942 元; 本报告期基金份额净值增长率为 5.63%, 同期基准收益率为 4.76%。日均跟踪误差为 0.05%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 影响 A 股市场的基本面因素没有变化, 对于投资者来说, 仍然要重点关注国内外经济走势、以及相对应的宏观经济政策取向等。由于适逢国内经济转型, 预计宏观经济政策出现较大变动的可能性不大, 证券市场的走势更多要顺应经济自身的运行节奏, 我们预计, 下半年沪深 300 指数将维持底部逐步抬高的震荡格局。

我们建议投资者坚持长期投资的理念，考虑逢低增持沪深 300 基金。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金可供分配利润为-100,932,807.61元，期末基金份额净值0.882元，不符合利润分配条件，本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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，本基金托管人在对鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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，鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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，鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2012 年上半年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：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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	36,671,084.44	31,468,931.19
结算备付金		1,225,381.36	32,850.20
存出保证金		57,851.40	35,282.18
交易性金融资产	6.4.7.2	716,806,041.90	586,608,218.64
其中：股票投资		716,806,041.90	586,608,218.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		290,896.94	1,413,852.23
应收利息	6.4.7.5	7,389.10	6,269.22
应收股利		1,290,854.02	-
应收申购款		482,375.83	237,055.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		756,831,874.99	619,802,459.06
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		219,218.61	-
应付赎回款		388,696.19	896,332.13
应付管理人报酬		475,123.14	397,431.29
应付托管费		95,024.62	79,486.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	224,672.58	80,631.67
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	223,920.93	92,282.21
负债合计		1,626,656.07	1,546,163.55
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	856,138,026.53	740,108,465.41
未分配利润	6.4.7.10	-100,932,807.61	-121,852,169.90
所有者权益合计		755,205,218.92	618,256,295.51
负债和所有者权益总计		756,831,874.99	619,802,459.06

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.882 元，基金份额总额 856,138,026.53 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间
		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		29,539,792.45	1,176,295.23

1.利息收入		140,943.64	203,801.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	140,750.49	203,152.56
债券利息收入		193.15	648.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,296,059.43	28,101,970.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,981,699.92	21,552,023.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	77,330.75	249,887.45
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	8,608,309.74	6,300,059.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	43,557,602.50	-28,079,351.81
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	137,305.74	949,875.44
二、费用		3,943,375.17	6,225,674.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,631,059.64	3,650,878.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	526,211.97	730,175.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	562,529.42	1,616,157.85
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	223,574.14	228,462.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,596,417.28	-5,049,379.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,596,417.28	-5,049,379.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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）	740,108,465.41	-121,852,169.90	618,256,295.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,596,417.28	25,596,417.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	116,029,561.12	-4,677,054.99	111,352,506.13
其中：1.基金申购款	290,859,492.04	-20,619,706.32	270,239,785.72
2.基金赎回款	-174,829,930.92	15,942,651.33	-158,887,279.59
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）	856,138,026.53	-100,932,807.61	755,205,218.92
	上年度可比期间		
	2011年1月1日至2011年6月30日		
项目	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）	1,283,290,528.96	119,604,680.96	1,402,895,209.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,049,379.61	-5,049,379.61
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）	-595,929,957.42	-66,709,605.90	-662,639,563.32
其中：1.基金申购款	119,986,769.04	13,770,882.96	133,757,652.00
2.基金赎回款	-715,916,726.46	-80,480,488.86	-796,397,215.32
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）	687,360,571.54	47,845,695.45	735,206,266.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理公司负责人

胡湘

主管会计工作负责人

刘慧红

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2009]41 号文《关于核准鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,994,133,345.09 元, 经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字 (2009)第 051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》于 2009 年 4 月 3 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,994,428,997.48 份基金份额, 其中认购资金利息折合 295,652.39 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2009]第 32 号文审核同意, 本基金 394,502,086.00 份基金份额于 2009 年 5 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股 (投资比例不低于基金资产净值的 90%), 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 为更好的实现投资目标, 本基金将少量投资于非沪深 300 成份股、新股 (首次发行或增发等) 以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行同业存款利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本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 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

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	36,671,084.44
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	36,671,084.44

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	827,969,610.18	716,806,041.90	-111,163,568.28
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	827,969,610.18	716,806,041.90	-111,163,568.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	6,892.84
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	496.26
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	7,389.10

6.4.7.6 其他资产

截至本报告期末，本基金未持有其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	224,672.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	224,672.58

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	648.79
预提费用	223,272.14
合计	223,920.93

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	740,108,465.41	740,108,465.41
本期申购	290,859,492.04	290,859,492.04
本期赎回(以“-”号填列)	-174,829,930.92	-174,829,930.92
本期末	856,138,026.53	856,138,026.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	123,349,990.44	-245,202,160.34	-121,852,169.90
本期利润	-17,961,185.22	43,557,602.50	25,596,417.28
本期基金份额交易产生的变动数	16,913,360.91	-21,590,415.90	-4,677,054.99
其中：基金申购款	43,561,727.63	-64,181,433.95	-20,619,706.32
基金赎回款	-26,648,366.72	42,591,018.05	15,942,651.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,302,166.13	-223,234,973.74	-100,932,807.61

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	3,262.33
其他	1,269.68
合计	140,750.49

注：其他为申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	145,643,352.27
减：卖出股票成本总额	168,625,052.19
买卖股票差价收入	-22,981,699.92

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	1,252,523.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,175,000.00
减：应收利息总额	193.15
债券投资收益	77,330.75

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

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	8,608,309.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,608,309.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	43,557,602.50

——股票投资	43,557,602.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	43,557,602.50

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	105,613.13
转换费收入	31,692.61
合计	137,305.74

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	562,529.42
银行间市场交易费用	-
合计	562,529.42

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	44,256.94
信息披露费	149,179.94
银行划付费	302.00
上市年费	29,835.26
合计	223,574.14

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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
国信证券	399,968,238.24	100.00%	857,304,002.36	100.00%

6.4.10.1.2 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
国信证券	1,252,523.90	100.00%	3,129,536.00	100.00%

6.4.10.1.3 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发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 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进行权证交易。

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
国信证券	337,733.93	100.00%	224,672.58	100.00%
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
国信证券	720,534.68	100.00%	207,376.75	100.00%

注：1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

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	2,631,059.64
其中：支付销售机构的客户维护费	445,384.89	487,512.66

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

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
----	----	---------

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	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	526, 211. 97	730, 175. 65

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0. 15%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0. 15%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间管理人未投资、持有本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		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	36, 671, 084. 44	136, 218. 48	36, 752, 208. 54	199, 457. 68

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	辽通化工	2012年6月26日	筹划非公开发行股票	7.91	2012年7月3日	8.15	87,812	871,175.19	694,592.92	-
002500	山西证券	2012年5月15日	筹划发行股份购买资产	8.19	-	-	71,323	623,743.25	584,135.37	-

注：山西证券股份有限公司 2011 年度利润分配方案为：向全体股东每 10 股派发现金 0.50 元（含税），股权登记日为 2012 年 6 月 20 日，除权除息日为 2012 年 6 月 21 日。

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，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各

业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2011 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示

的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等,其余大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,671,084.44	-	-	-	36,671,084.44
结算备付金	1,225,381.36	-	-	-	1,225,381.36
存出保证金	-	-	-	57,851.40	57,851.40
交易性金融资产	-	-	-	716,806,041.90	716,806,041.90
应收证券清算款	-	-	-	290,896.94	290,896.94
应收利息	-	-	-	7,389.10	7,389.10
应收股利	-	-	-	1,290,854.02	1,290,854.02
应收申购款	-	-	-	482,375.83	482,375.83
资产总计	37,896,465.80	-	-	718,935,409.19	756,831,874.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	219,218.61	219,218.61
应付赎回款	-	-	-	388,696.19	388,696.19
应付管理人报酬	-	-	-	475,123.14	475,123.14

应付托管费	-	-	-	95,024.62	95,024.62
应付交易费用	-	-	-	224,672.58	224,672.58
其他负债	-	-	-	223,920.93	223,920.93
负债总计	-	-	-	1,626,656.07	1,626,656.07
利率敏感度缺口	37,896,465.80	-	-	717,308,753.12	755,205,218.92
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	31,468,931.19	-	-	-	31,468,931.19
结算备付金	32,850.20	-	-	-	32,850.20
存出保证金	-	-	-	35,282.18	35,282.18
交易性金融资产	-	-	-	586,608,218.64	586,608,218.64
应收证券清算款	-	-	-	1,413,852.23	1,413,852.23
应收利息	-	-	-	6,269.22	6,269.22
应收申购款	-	-	-	237,055.40	237,055.40
资产总计	31,501,781.39	-	-	588,300,677.67	619,802,459.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	896,332.13	896,332.13
应付管理人报酬	-	-	-	397,431.29	397,431.29
应付托管费	-	-	-	79,486.25	79,486.25
应付交易费用	-	-	-	80,631.67	80,631.67
其他负债	-	-	-	92,282.21	92,282.21
负债总计	-	-	-	1,546,163.55	1,546,163.55
利率敏感度缺口	31,501,781.39	-	-	586,754,514.12	618,256,295.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资（2011 年 12 月 31 日：未持有），因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2011 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 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	716,806,041.90	94.92	586,608,218.64	94.88
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	716,806,041.90	94.92	586,608,218.64	94.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		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%	37,759,279.81	31,010,813.28
	业绩比较基准下降 5%	-37,759,279.81	-31,010,813.28

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 715,527,313.61 元，属于第二层级的余额为 1,278,728.29 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 584,442,090.14 元，第二层级 2,166,128.50 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的
----	----	----	---------

			比例 (%)
1	权益投资	716,806,041.90	94.71
	其中：股票	716,806,041.90	94.71
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	37,896,465.80	5.01
6	其他各项资产	2,129,367.29	0.28
7	合计	756,831,874.99	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	4,184,184.69	0.55
B	采掘业	72,931,100.22	9.66
C	制造业	252,470,727.53	33.43
C0	食品、饮料	52,997,324.83	7.02
C1	纺织、服装、皮毛	2,716,095.27	0.36
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,067,442.87	2.13
C5	电子	13,747,681.72	1.82
C6	金属、非金属	59,061,414.67	7.82
C7	机械、设备、仪表	75,308,608.42	9.97
C8	医药、生物制品	32,342,717.17	4.28
C99	其他制造业	229,442.58	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,114,776.85	2.53
E	建筑业	25,700,434.32	3.40
F	交通运输、仓储业	18,828,612.13	2.49
G	信息技术业	20,508,291.58	2.72
H	批发和零售贸易	20,358,978.84	2.70
I	金融、保险业	221,566,783.35	29.34
J	房地产业	41,219,464.55	5.46
K	社会服务业	6,146,724.91	0.81
L	传播与文化产业	2,399,725.25	0.32

M	综合类	11,376,237.68	1.51
	合计	716,806,041.90	94.92

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	3,784,376	22,668,412.24	3.00
2	601318	中国平安	489,980	22,411,685.20	2.97
3	600036	招商银行	1,808,466	19,748,448.72	2.61
4	601328	交通银行	3,348,397	15,201,722.38	2.01
5	600519	贵州茅台	60,730	14,523,579.50	1.92
6	601166	兴业银行	1,104,195	14,332,451.10	1.90
7	600000	浦发银行	1,636,748	13,306,761.24	1.76
8	600030	中信证券	1,007,166	12,720,506.58	1.68
9	000002	万科A	1,415,656	12,613,494.96	1.67
10	600837	海通证券	1,183,406	11,396,199.78	1.51
11	601939	建设银行	2,599,517	10,917,971.40	1.45
12	601088	中国神华	482,335	10,842,890.80	1.44
13	601601	中国太保	459,688	10,195,879.84	1.35
14	000858	五粮液	277,564	9,092,996.64	1.20
15	600111	包钢稀土	212,522	8,386,118.12	1.11
16	601288	农业银行	2,991,598	7,748,238.82	1.03
17	601668	中国建筑	2,193,624	7,326,704.16	0.97
18	600048	保利地产	626,323	7,102,502.82	0.94
19	000157	中联重科	642,687	6,446,150.61	0.85
20	000651	格力电器	307,912	6,419,965.20	0.85
21	002304	洋河股份	47,382	6,375,248.10	0.84
22	601169	北京银行	643,474	6,286,740.98	0.83
23	600031	三一重工	444,206	6,183,347.52	0.82
24	601006	大秦铁路	869,657	6,113,688.71	0.81
25	000001	深发展A	374,623	5,679,284.68	0.75
26	002024	苏宁电器	613,882	5,150,469.98	0.68

27	601818	光大银行	1,773,974	5,038,086.16	0.67
28	600900	长江电力	723,896	4,922,492.80	0.65
29	600887	伊利股份	233,788	4,811,357.04	0.64
30	600015	华夏银行	500,857	4,743,115.79	0.63
31	601857	中国石油	519,154	4,698,343.70	0.62
32	600050	中国联通	1,239,929	4,612,535.88	0.61
33	600104	上汽集团	322,479	4,608,224.91	0.61
34	601899	紫金矿业	1,155,586	4,483,673.68	0.59
35	600585	海螺水泥	292,461	4,334,272.02	0.57
36	000568	泸州老窖	101,947	4,313,377.57	0.57
37	600383	金地集团	653,920	4,237,401.60	0.56
38	600256	广汇能源	307,490	4,141,890.30	0.55
39	000063	中兴通讯	287,707	4,016,389.72	0.53
40	601628	中国人寿	219,362	4,014,324.60	0.53
41	600999	招商证券	340,823	3,956,955.03	0.52
42	600028	中国石化	626,158	3,944,795.40	0.52
43	000776	广发证券	129,847	3,873,336.01	0.51
44	600011	华能国际	598,500	3,860,325.00	0.51
45	002081	金螳螂	100,700	3,826,600.00	0.51
46	000983	西山煤电	230,418	3,594,520.80	0.48
47	600518	康美药业	225,080	3,470,733.60	0.46
48	600547	山东黄金	104,056	3,417,199.04	0.45
49	000069	华侨城 A	531,697	3,392,226.86	0.45
50	601989	中国重工	643,508	3,339,806.52	0.44
51	600019	宝钢股份	768,297	3,319,043.04	0.44
52	000338	潍柴动力	110,710	3,286,979.90	0.44
53	000527	美的电器	296,959	3,281,396.95	0.43
54	000792	盐湖股份	93,039	3,141,927.03	0.42
55	002241	歌尔声学	85,410	3,116,610.90	0.41
56	600739	辽宁成大	199,577	3,113,401.20	0.41
57	600489	中金黄金	143,474	3,087,560.48	0.41
58	000423	东阿阿胶	76,516	3,061,405.16	0.41
59	600795	国电电力	1,125,680	3,039,336.00	0.40
60	000725	京东方 A	1,554,100	2,968,331.00	0.39
61	000046	泛海建设	653,400	2,920,698.00	0.39
62	600362	江西铜业	121,395	2,902,554.45	0.38
63	601988	中国银行	1,019,544	2,875,114.08	0.38
64	601699	潞安环能	134,605	2,791,707.70	0.37
65	600690	青岛海尔	235,606	2,761,302.32	0.37

66	000629	攀钢钒钛	418,726	2,755,217.08	0.36
67	000895	双汇发展	44,310	2,741,902.80	0.36
68	600348	阳泉煤业	175,855	2,690,581.50	0.36
69	601788	光大证券	199,941	2,633,222.97	0.35
70	600089	特变电工	385,428	2,609,347.56	0.35
71	600276	恒瑞医药	90,418	2,595,900.78	0.34
72	601600	中国铝业	420,469	2,594,293.73	0.34
73	601009	南京银行	303,927	2,589,458.04	0.34
74	600406	国电南瑞	138,245	2,583,799.05	0.34
75	601688	华泰证券	245,685	2,579,692.50	0.34
76	000024	招商地产	100,757	2,471,569.21	0.33
77	601299	中国北车	603,688	2,420,788.88	0.32
78	000538	云南白药	40,612	2,407,479.36	0.32
79	601669	中国水电	550,800	2,406,996.00	0.32
80	601168	西部矿业	278,795	2,386,485.20	0.32
81	600315	上海家化	60,900	2,375,709.00	0.31
82	601766	中国南车	516,774	2,356,489.44	0.31
83	000402	金融街	354,148	2,312,586.44	0.31
84	600827	友谊股份	197,600	2,234,856.00	0.30
85	000783	长江证券	242,741	2,208,943.10	0.29
86	600022	山东钢铁	832,100	2,138,497.00	0.28
87	000709	河北钢铁	776,441	2,119,683.93	0.28
88	600309	烟台万华	158,111	2,110,781.85	0.28
89	601898	中煤能源	267,680	2,071,843.20	0.27
90	000100	TCL 集团	991,660	2,013,069.80	0.27
91	000630	铜陵有色	103,949	2,006,215.70	0.27
92	601186	中国铁建	450,186	2,003,327.70	0.27
93	600068	葛洲坝	306,006	1,998,219.18	0.26
94	600100	同方股份	232,547	1,958,045.74	0.26
95	600600	青岛啤酒	50,885	1,943,298.15	0.26
96	601390	中国中铁	749,890	1,927,217.30	0.26
97	600642	申能股份	414,926	1,912,808.86	0.25
98	000878	云南铜业	103,568	1,853,867.20	0.25
99	600010	宝钢股份	375,761	1,833,713.68	0.24
100	600660	福耀玻璃	234,335	1,832,499.70	0.24
101	000060	中金岭南	211,181	1,820,380.22	0.24
102	600123	兰花科创	100,239	1,810,316.34	0.24
103	600009	上海机场	140,900	1,795,066.00	0.24
104	601958	金钼股份	141,559	1,793,552.53	0.24

105	601618	中国中冶	712,445	1,766,863.60	0.23
106	600549	厦门钨业	39,893	1,751,701.63	0.23
107	601666	平煤股份	172,650	1,747,218.00	0.23
108	600875	东方电气	97,330	1,744,153.60	0.23
109	600583	海油工程	284,399	1,731,989.91	0.23
110	000425	徐工机械	120,664	1,730,321.76	0.23
111	000012	南玻A	191,978	1,727,802.00	0.23
112	600196	复星医药	167,100	1,722,801.00	0.23
113	002142	宁波银行	168,693	1,683,556.14	0.22
114	000039	中集集团	126,110	1,677,263.00	0.22
115	601117	中国化学	288,563	1,665,008.51	0.22
116	600085	同仁堂	95,208	1,661,379.60	0.22
117	600177	雅戈尔	195,373	1,658,716.77	0.22
118	600535	天士力	37,761	1,650,910.92	0.22
119	601991	大唐发电	292,318	1,645,750.34	0.22
120	600188	兖州煤业	86,575	1,643,193.50	0.22
121	002422	科伦药业	35,097	1,637,626.02	0.22
122	601998	中信银行	402,514	1,610,056.00	0.21
123	600143	金发科技	269,681	1,609,995.57	0.21
124	000009	中国宝安	159,513	1,595,130.00	0.21
125	002415	海康威视	58,496	1,591,091.20	0.21
126	600005	武钢股份	590,452	1,588,315.88	0.21
127	000581	威孚高科	57,860	1,585,364.00	0.21
128	000728	国元证券	143,616	1,566,850.56	0.21
129	601919	中国远洋	334,996	1,554,381.44	0.21
130	600415	小商品城	199,006	1,552,246.80	0.21
131	000937	冀中能源	101,471	1,549,462.17	0.21
132	600066	宇通客车	68,962	1,548,886.52	0.21
133	600166	福田汽车	215,965	1,544,149.75	0.20
134	601336	新华保险	45,000	1,540,800.00	0.20
135	600369	西南证券	135,861	1,536,587.91	0.20
136	600271	航天信息	81,023	1,532,144.93	0.20
137	600881	亚泰集团	277,088	1,523,984.00	0.20
138	002155	辰州矿业	78,451	1,518,811.36	0.20
139	601111	中国国航	243,617	1,498,244.55	0.20
140	600376	首开股份	109,291	1,447,012.84	0.19
141	002202	金风科技	224,653	1,440,025.73	0.19
142	600694	大商股份	42,953	1,436,777.85	0.19
143	601808	中海油服	86,588	1,429,567.88	0.19

144	600115	东方航空	341,425	1,427,156.50	0.19
145	600150	中国船舶	62,011	1,424,392.67	0.19
146	000768	西飞国际	181,165	1,422,145.25	0.19
147	600029	南方航空	308,101	1,420,345.61	0.19
148	000562	宏源证券	85,475	1,413,756.50	0.19
149	600153	建发股份	196,351	1,405,873.16	0.19
150	600058	五矿发展	62,703	1,400,157.99	0.19
151	600252	中恒集团	127,727	1,399,887.92	0.19
152	000623	吉林敖东	80,494	1,395,765.96	0.18
153	000401	冀东水泥	98,531	1,385,345.86	0.18
154	600741	华域汽车	151,108	1,355,438.76	0.18
155	600497	驰宏锌锗	95,795	1,347,835.65	0.18
156	000729	燕京啤酒	184,453	1,346,506.90	0.18
157	000933	神火股份	147,411	1,344,388.32	0.18
158	000625	长安汽车	275,000	1,342,000.00	0.18
159	000869	张裕A	19,894	1,338,070.44	0.18
160	601901	方正证券	263,200	1,337,056.00	0.18
161	600655	豫园商城	168,157	1,325,077.16	0.18
162	000960	锡业股份	66,285	1,305,814.50	0.17
163	600395	盘江股份	48,407	1,301,180.16	0.17
164	000800	一汽轿车	119,004	1,292,383.44	0.17
165	000422	湖北宣化	105,044	1,286,789.00	0.17
166	000758	中色股份	67,270	1,276,111.90	0.17
167	002353	杰瑞股份	26,300	1,275,550.00	0.17
168	000999	华润三九	57,262	1,251,174.70	0.17
169	600832	东方明珠	232,987	1,251,140.19	0.17
170	002106	莱宝高科	61,462	1,233,542.34	0.16
171	000528	柳工	98,734	1,225,288.94	0.16
172	601333	广深铁路	413,296	1,215,090.24	0.16
173	600779	水井坊	50,029	1,214,203.83	0.16
174	600649	城投控股	168,038	1,213,234.36	0.16
175	601106	中国一重	382,451	1,208,545.16	0.16
176	600259	广晟有色	18,236	1,202,299.48	0.16
177	601607	上海医药	112,490	1,200,268.30	0.16
178	601717	郑煤机	102,369	1,187,480.40	0.16
179	000825	太钢不锈	333,211	1,176,234.83	0.16
180	600804	鹏博士	195,746	1,162,731.24	0.15
181	600703	三安光电	84,469	1,149,623.09	0.15
182	000876	新希望	76,235	1,142,000.30	0.15

183	600839	四川长虹	540,069	1,139,545.59	0.15
184	002385	大北农	58,613	1,137,092.20	0.15
185	600219	南山铝业	169,712	1,137,070.40	0.15
186	600125	铁龙物流	133,645	1,133,309.60	0.15
187	600208	新湖中宝	272,479	1,125,338.27	0.15
188	002001	新和成	53,081	1,121,601.53	0.15
189	600588	用友软件	71,591	1,092,478.66	0.14
190	600320	振华重工	258,284	1,089,958.48	0.14
191	601888	中国国旅	38,607	1,089,489.54	0.14
192	002038	双鹭药业	33,404	1,075,608.80	0.14
193	600267	海正药业	61,421	1,073,639.08	0.14
194	601001	大同煤业	97,905	1,072,059.75	0.14
195	600811	东方集团	195,073	1,069,000.04	0.14
196	000898	鞍钢股份	269,772	1,052,110.80	0.14
197	600372	中航电子	57,700	1,038,023.00	0.14
198	600893	航空动力	79,670	1,036,506.70	0.14
199	002007	华兰生物	42,132	1,035,604.56	0.14
200	002310	东方园林	17,628	1,034,939.88	0.14
201	002092	中泰化学	135,050	1,033,132.50	0.14
202	601179	中国西电	254,869	1,014,378.62	0.13
203	601101	昊华能源	58,496	1,001,451.52	0.13
204	600674	川投能源	144,242	998,154.64	0.13
205	600216	浙江医药	39,490	993,173.50	0.13
206	601918	国投新集	81,181	991,220.01	0.13
207	600266	北京城建	65,019	987,638.61	0.13
208	600108	亚盛集团	199,304	982,568.72	0.13
209	600331	宏达股份	120,737	970,725.48	0.13
210	600895	张江高科	113,241	970,475.37	0.13
211	000718	苏宁环球	119,519	968,103.90	0.13
212	600062	华润双鹤	50,163	957,110.04	0.13
213	601018	宁波港	374,378	947,176.34	0.13
214	600997	开滦股份	90,277	945,200.19	0.13
215	601928	凤凰传媒	109,800	944,280.00	0.13
216	000061	农产品	161,838	938,660.40	0.12
217	000778	新兴铸管	140,163	937,690.47	0.12
218	600718	东软集团	107,715	927,426.15	0.12
219	000969	安泰科技	75,706	925,884.38	0.12
220	600859	王府井	33,837	925,780.32	0.12
221	000839	中信国安	137,578	924,524.16	0.12

222	600664	哈药股份	140,207	923,964.13	0.12
223	600132	重庆啤酒	42,466	916,840.94	0.12
224	600863	内蒙华电	113,244	894,627.60	0.12
225	002146	荣盛发展	81,764	891,227.60	0.12
226	601866	中海集运	348,002	880,445.06	0.12
227	600550	天威保变	100,394	876,439.62	0.12
228	002069	獐子岛	41,597	867,297.45	0.11
229	600352	浙江龙盛	150,373	861,637.29	0.11
230	600498	烽火通信	32,343	857,412.93	0.11
231	002570	贝因美	42,200	850,330.00	0.11
232	600118	中国卫星	67,022	843,806.98	0.11
233	600221	海南航空	172,891	843,708.08	0.11
234	600160	巨化股份	82,884	837,128.40	0.11
235	601158	重庆水务	140,391	826,902.99	0.11
236	601558	华锐风电	117,291	822,209.91	0.11
237	600316	洪都航空	62,923	819,886.69	0.11
238	000703	恒逸石化	49,200	818,196.00	0.11
239	600516	方大炭素	93,527	798,720.58	0.11
240	000807	云铝股份	135,054	795,468.06	0.11
241	601118	海南橡胶	114,980	789,912.60	0.10
242	600432	吉恩镍业	59,309	787,623.52	0.10
243	000680	山推股份	133,225	779,366.25	0.10
244	601633	长城汽车	43,700	777,860.00	0.10
245	600598	北大荒	103,988	774,710.60	0.10
246	002299	圣农发展	53,303	769,695.32	0.10
247	600508	上海能源	42,276	766,463.88	0.10
248	601555	东吴证券	86,600	765,544.00	0.10
249	600812	华北制药	120,336	765,336.96	0.10
250	002128	露天煤业	58,205	761,321.40	0.10
251	601098	中南传媒	78,794	754,846.52	0.10
252	600169	太原重工	212,689	746,538.39	0.10
253	600770	综艺股份	64,615	741,780.20	0.10
254	600970	中材国际	63,954	738,029.16	0.10
255	600170	上海建工	101,464	732,570.08	0.10
256	002073	软控股份	86,851	727,811.38	0.10
257	600528	中铁二局	106,697	721,271.72	0.10
258	600809	山西汾酒	18,993	715,846.17	0.09
259	600418	江淮汽车	131,926	713,719.66	0.09
260	600500	中化国际	105,154	710,841.04	0.09

261	600037	歌华有线	93,041	700,598.73	0.09
262	000059	辽通化工	87,812	694,592.92	0.09
263	601566	九牧王	24,700	687,895.00	0.09
264	601377	兴业证券	64,346	674,346.08	0.09
265	601369	陕鼓动力	71,896	665,756.96	0.09
266	000686	东北证券	37,397	640,984.58	0.08
267	002344	海宁皮城	24,568	640,733.44	0.08
268	000961	中南建设	51,236	638,400.56	0.08
269	600109	国金证券	43,883	631,476.37	0.08
270	000780	平庄能源	59,333	621,809.84	0.08
271	600595	中孚实业	110,768	618,085.44	0.08
272	600971	恒源煤电	43,872	611,136.96	0.08
273	601933	永辉超市	22,459	608,638.90	0.08
274	600546	山煤国际	28,991	606,491.72	0.08
275	601992	金隅股份	91,089	605,741.85	0.08
276	600456	宝钛股份	31,461	590,522.97	0.08
277	000559	万向钱潮	116,500	585,995.00	0.08
278	002500	山西证券	71,323	584,135.37	0.08
279	002431	棕榈园林	22,462	579,294.98	0.08
280	000968	煤气化	37,565	572,866.25	0.08
281	002122	天马股份	86,867	561,160.82	0.07
282	600096	云天化	40,575	538,024.50	0.07
283	600183	生益科技	104,052	535,867.80	0.07
284	601718	际华集团	169,216	534,722.56	0.07
285	600873	梅花集团	79,211	534,674.25	0.07
286	600783	鲁信创投	32,656	521,189.76	0.07
287	000021	长城开发	96,466	518,987.08	0.07
288	002493	荣盛石化	32,524	498,592.92	0.07
289	002399	海普瑞	23,404	496,164.80	0.07
290	601258	庞大集团	76,674	467,711.40	0.06
291	601099	太平洋	65,954	455,082.60	0.06
292	002603	以岭药业	16,159	445,180.45	0.06
293	600307	酒钢宏兴	119,665	415,237.55	0.05
294	002405	四维图新	33,713	402,533.22	0.05
295	002378	章源钨业	12,524	396,509.84	0.05
296	601233	桐昆股份	42,275	369,483.50	0.05
297	601268	二重重装	49,429	302,999.77	0.04
298	601216	内蒙君正	37,437	260,935.89	0.03
299	002594	比亚迪	11,553	229,442.58	0.03

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	600016	民生银行	8,013,041.24	1.30
2	600036	招商银行	6,618,701.60	1.07
3	601318	中国平安	5,977,789.51	0.97
4	601328	交通银行	4,760,182.84	0.77
5	600000	浦发银行	4,527,542.58	0.73
6	601166	兴业银行	4,481,172.82	0.72
7	601939	建设银行	4,172,856.38	0.67
8	601088	中国神华	3,869,822.52	0.63
9	600519	贵州茅台	3,867,010.71	0.63
10	002081	金螳螂	3,849,138.78	0.62
11	600030	中信证券	3,776,962.91	0.61
12	600011	华能国际	3,667,327.71	0.59
13	000002	万科 A	3,648,874.25	0.59
14	600837	海通证券	3,285,711.96	0.53
15	000046	泛海建设	3,039,826.10	0.49
16	000725	京东方 A	3,001,758.59	0.49
17	601601	中国太保	2,929,535.46	0.47
18	000858	五粮液	2,905,385.76	0.47
19	002241	歌尔声学	2,809,891.72	0.45
20	601669	中国水电	2,497,185.00	0.40

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	5,364,094.61	0.87

2	600036	招商银行	4,097,630.09	0.66
3	601318	中国平安	3,648,859.74	0.59
4	601328	交通银行	2,909,916.21	0.47
5	600000	浦发银行	2,754,617.59	0.45
6	601166	兴业银行	2,708,519.86	0.44
7	601939	建设银行	2,641,093.96	0.43
8	601088	中国神华	2,373,672.27	0.38
9	600519	贵州茅台	2,270,064.78	0.37
10	600030	中信证券	2,231,555.01	0.36
11	000002	万 科 A	2,203,394.60	0.36
12	600837	海通证券	2,090,423.71	0.34
13	601601	中国太保	1,776,911.28	0.29
14	601727	上海电气	1,766,599.80	0.29
15	000858	五 粮 液	1,698,157.15	0.27
16	601288	农业银行	1,411,944.56	0.23
17	601668	中国建筑	1,317,724.15	0.21
18	600111	包钢稀土	1,309,366.77	0.21
19	601006	大秦铁路	1,209,482.84	0.20
20	600031	三一重工	1,157,499.80	0.19

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	255,265,272.95
卖出股票收入（成交）总额	145,643,352.27

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.9.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,851.40
2	应收证券清算款	290,896.94
3	应收股利	1,290,854.02
4	应收利息	7,389.10
5	应收申购款	482,375.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,129,367.29

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.9.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
30,918	27,690.60	272,057,344.52	31.78%	584,080,682.01	68.22%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	袁曼玲	2,199,179.00	5.38%
2	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	2.13%
3	乐子炎	795,495.00	1.95%
4	张志勇	713,000.00	1.75%
5	杨锋	666,503.00	1.63%
6	徐志林	605,000.00	1.48%
7	李淑萍	572,292.00	1.40%
8	张立强	550,000.00	1.35%
9	薛小林	515,462.00	1.26%
10	赵凡	500,400.00	1.22%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	370,858.72	0.0433%

注：(1) 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

(2) 本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

(3) 截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 4 月 3 日）基金份额总额	1,994,428,997.48
本报告期期初基金份额总额	740,108,465.41
本报告期基金总申购份额	290,859,492.04
减：本报告期基金总赎回份额	174,829,930.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	856,138,026.53

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人——鹏华基金管理有限公司本报告期内没有发生重大人事变动。

10.2.2 报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	399,968,238.24	100.00%	337,733.93	100.00%	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，分别向国信证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司租用交易单元作为基金专用交易单元，并从 2009 年 4 月开始陆续使用。本报告期内上述交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
国信证券	1,252,523.90	100.00%	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 2011 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 1 月 18 日
2	鹏华基金新增南京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 年 1 月 20 日
3	鹏华基金参与广州银行网上银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 2 月 22 日
4	鹏华基金新增广州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 年 2 月 22 日
5	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者谨防假冒我公司名义	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 23 日
6	鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 2011 年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 26 日
7	鹏华沪深 300 基金参与邮储银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 29 日
8	鹏华基金新增邮储银行为鹏华沪深 300 基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 29 日
9	鹏华基金参与工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 31 日
10	鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 4 月 24 日
11	鹏华基金参与邮储银行手机银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 4 月 27 日
12	鹏华基金参与交通银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 6 月 28 日
13	鹏华基金参与中信银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 6 月 28 日
14	关于鹏华旗下部分基金参与银河证券网上交易和柜台系统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 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2012 年 8 月 29 日