上证50交易型开放式指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十四日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华夏上证50ETF
基金主代码	510050
交易代码	510050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2004年12月30日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,360,566,757份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2005年2月23日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为"上证50指数"。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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	-2,507,760.72
本期利润	314,539,966.58
加权平均基金份额本期利润	0.0315
本期基金份额净值增长率	1.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.1535
期末基金资产净值	20,702,774,626.19
期末基金份额净值	1.998

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

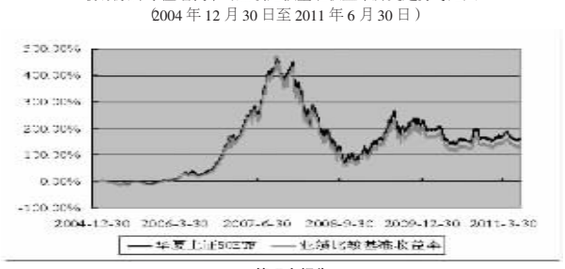
3.2 基金净值表现

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	0.00%	1.13%	-1.05%	1.14%	1.05%	-0.01%
过去三个月	-3.62%	1.10%	-4.53%	1.11%	0.91%	-0.01%
过去六个月	1.32%	1.19%	0.61%	1.19%	0.71%	0.00%
过去一年	9.86%	1.35%	9.36%	1.36%	0.50%	-0.01%
过去三年	-5.86%	1.99%	-8.56%	2.04%	2.70%	-0.05%
自基金合同生效起至今	162.85%	1.93%	135.78%	2.00%	27.07%	-0.07%

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

上证50交易型开放式指数证券投资基金
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
(2004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

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

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

2011年3月,在《证券时报》举办的"第七届中国基金业明星奖颁奖仪式暨中国明星基金论坛"中,华夏基金获得"长期回报明星基金公司奖";2011年4月,在《上海证券报》主办的"中国'金基金'奖"颁奖典礼中,华夏基金第六次荣获"金基金TOP公司奖";在《中国证券报》、中央电视台主办的"中国基金业金牛奖"评选中,华夏基金第六次荣获年度"金牛基金管理公司奖"。

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方军	本基金的基金经理	2004-12-30	-	12年	硕士,1999年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员,华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,我国经济保持较快增长,但也面临着较大的通胀压力,央行通过加息及多次上调存款准备金率等手段来收缩流动性。与此同时,美国经济复苏乏力、欧洲债务危机升级、中东和北非地区的政局动荡及日本地震的后续影响也对全球经济的复苏产生了较大的影响。

市场方面,A股市场总体呈现先扬后抑的走势,结构分化比较明显,大盘股表现相对较好,中小盘股则表现较差。行业上,建材、钢铁、煤炭及以银行、地产等为代表的低估值类股票表现较好,而医药生物、信息技术、旅游、农业等前期估值较高的股票则表现明显落后。

上证50指数金融类股票权重超过50%,整体估值较低,在上半年的结构分化行情中表现较好。报告期内,上证50指数上涨0.61%,好于市场平均水平。

在操作中,我们严格按照基金合同要求,在指数权重及成份股变动时,尽量降低成本、减少市场冲击,逐步调整组合至目标结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为1.998元,本报告期份额净值增长率为1.32%,同期上证50指数增长率为0.61%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,通胀有望见顶回落,但短期内控通胀仍将是我国宏观政策的首要目标,流动性仍可能偏紧。但若经济增速明显放缓,也不排除调控政策出现放松的可能。A股市场经过2季度较大幅度的调整后,长期投资价值已逐步显现,市场进一步下跌的空间有限。因此,我们认为,下半年市场总体可能呈现震荡格局,若宏观调控政策出现放松迹象,市场也可能会有整体性的行情。

上证50指数代表的大盘蓝筹股,估值较低,下行风险较小,在下半年的市场中可能仍会有较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时,我们也积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥ETF的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年上半年,本基金托管人在对上证50交易型开放式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,上证50交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在上证50交易型开放式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,上证50交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的上证50交易型开放式指数证券投资基金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:上证50交易型开放式指数证券投资基金

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		241,542,417.08	205,975,952.39
结算备付金		574,949.28	4,950,768.78
存出保证金		763.26	693.75
交易性金融资产		20,437,041,718.32	19,658,210,291.87
其中:股票投资		20,437,041,718.32	19,658,210,291.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,002,064.28	101,772,817.39
应收利息		48,527.70	49,910.91
应收股利		47,151,761.58	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		20,727,362,201.50	19,970,960,435.09
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		-	369,465.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,279,719.69	8,804,109.89
应付托管费		1,655,943.95	1,760,821.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		13,070,762.70	12,827,554.45
应交税费		15,174.00	15,174.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,565,974.97	517,506.83
负债合计		24,587,575.31	24,294,632.77
所有者权益:			
实收基金		8,751,655,699.79	8,543,857,482.60
未分配利润		11,951,118,926.40	11,402,808,319.72
所有者权益合计		20,702,774,626.19	19,946,665,802.32
负债和所有者权益总计		20,727,362,201.50	19,970,960,435.09

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.998元,基金份额总额10,360,566,757份。

6.2 利润表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金

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		378,128,637.61	-7,763,127,207.90
1.利息收入		736,067.04	1,541,633.77
其中:存款利息收入		736,067.04	1,541,633.77
债券利息收入		-	-
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)		64,637,280.58	-4,211,084,511.32
其中:股票投资收益		-197,120,218.11	-4,343,324,205.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		261,757,498.69	132,239,694.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		317,047,727.30	-3,537,809,668.54
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-4,292,437.31	-15,774,661.81
减:二、费用		63,588,671.03	76,311,685.90
1.管理人报酬		50,091,633.27	59,774,006.72
2.托管费		10,018,326.70	11,954,801.38
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,276,053.36	4,377,076.37
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		202,657.70	205,801.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		314,539,966.58	-7,839,438,893.80
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		314,539,966.58	-7,839,438,893.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金

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)	8,543,857,482.60	11,402,808,319.72	19,946,665,802.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	314,539,966.58	314,539,966.58
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)	207,798,217.19	233,770,640.10	441,568,857.29
其中:1.基金申购款	12,714,547,831.64	17,904,526,310.77	30,619,074,142.41
2.基金赎回款	-12,506,749,614.45	-17,670,755,670.67	-30,177,505,285.12
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,751,655,699.79	11,951,118,926.40	20,702,774,626.19
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)	8,434,045,415.89	17,049,463,639.25	25,483,509,055.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,839,438,893.80	-7,839,438,893.80
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)	1,366,737,868.60	2,354,165,843.51	3,720,903,712.11
其中:1.基金申购款	29,908,583,248.57	48,554,311,067.86	78,462,894,316.43
2.基金赎回款	-28,541,845,379.97	-46,200,145,224.35	-74,741,990,604.32
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)	9,800,783,284.49	11,564,190,588.96	21,364,973,873.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金

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)	8,543,857,482.60	11,402,808,319.72	19,946,665,802.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	314,539,966.58	314,539,966.58
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)	207,798,217.19	233,770,640.10	441,568,857.29
其中:1.基金申购款	12,714,547,831.64	17,904,526,310.77	30,619,074,142.41
2.基金赎回款	-12,506,749,614.45	-17,670,755,670.67	-30,177,505,285.12
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,751,655,699.79	11,951,118,926.40	20,702,774,626.19
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)	8,434,045,415.89	17,049,463,639.25	25,483,509,055.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,839,438,893.80	-7,839,438,893.80
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)	1,366,737,868.60	2,354,165,843.51	3,720,903,712.11
其中:1.基金申购款	29,908,583,248.57	48,554,311,067.86	78,462,894,316.43
2.基金赎回款	-28,541,845,379.97	-46,200,145,224.35	-74,741,990,604.32
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)	9,800,783,284.49	11,564,190,588.96	21,364,973,873.45

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:

范勇宏　崔雁巍　崔雁巍

基金管理公司负责人　主管会计工作负责人　会计机构负责人

6.4 报表附注

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

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

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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	50,091,633.27	59,774,006.72

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

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

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托管费	10,018,326.70	11,954,801.38

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

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

6.4.4.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.4.5 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	241,542,417.08	713,528.01	321,438,842.66	1,503,655.05

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	承销方式	基金证券持有期末余额	
				数量	市值
中国工商银行	-	-	-	-	-
中国工商银行	600031	三一重工	配股发行	21,855,605	131,172,000.35

6.4.5 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年6月30日止,本基金没有因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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,437,041,718.32	98.60
	其中:股票	20,437,041,718.32	98.60
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	242,117,366.36	1.17
6	其他各项资产	48,203,116.82	0.23
7	合计	20,727,362,201.50	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	30,800,000.00	0.15
B	采掘业	3,555,520,106.42	17.17
C	制造业	3,584,690,027.62	17.32
C0	食品、饮料	679,159,781.96	3.28
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,555,945,096.80	7.52
C7	机械、设备、仪表	1,349,585,148.86	6.52
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	310,447,696.93	1.50
E	建筑业	636,196,644.65	3.07
F	交通运输、仓储业	741,243,895.22	3.58
G	信息技术业	393,050,154.00	1.90
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	10,585,159,439.78	51.13
J	房地产业	599,934,179.70	2.90
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	20,437,042,144.32	98.72

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细　金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	108,264,472	1,409,603,425.44	6.81
2	601318	中国平安	28,630,820	1,382,009,681.40	6.68
3	600016	民生银行	192,330,981	1,102,056,521.13	5.32
4	601328	交通银行	190,751,943	1,056,765,764.22	5.10
5	600000	浦发银行	94,259,327	927,511,777.68	4.48
6	601166	兴业银行	64,227,924	865,792,415.52	4.18
7	601088	中国神华	27,926,058	841,691,388.12	4.07
8	600519	贵州茅台	3,194,092	679,159,781.96	3.28
9	601601	中国太保	27,256,709	610,277,714.51	2.95
10	600837	海通证券	66,392,439	598,859,799.78	2.89

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

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	600585	海螺水泥	275,428,723.84	1.38
2	600031	三一重工	207,862,270.65	1.04
3	601288	农业银行	203,293,263.37	1.02
4	600837	海通证券	200,982,304.24	1.01
5	601989	中国重工	184,643,211.28	0.93
6	600348	国阳新能	170,615,709.56	0.86
7	600111	包钢稀土	161,282,422.30	0.81
8	601688	华泰证券	160,839,137.58	0.81
9	600000	浦发银行	130,780,188.79	0.66
10	600188	兖州煤业	122,215,632.52	0.61
11	601788	光大证券	115,627,749.44	0.58
12	601766	中国南车	91,922,197.01	0.46
13	601818	光大银行	85,819,527.00	0.43
14	600383	金地集团	60,253,759.61	0.30
15	601318	中国平安	58,525,084.16	0.29
16	600048	保利地产	53,889,626.96	0.27
17	601601	中国太保	45,929,074.38	0.23
18	601668	中国建筑	44,001,008.92	0.22
19	601988	中国银行	42,461,059.28	0.21
20	601600	中国铝业	39,456,946.57	0.20

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	601788	光大证券	187,851,345.09	0.94
2	600036	招商银行	168,572,010.70	0.85
3	600900	长江电力	153,761,848.39	0.77
4	600739	辽宁成大	151,672,243.72	0.76
5	601618	中国中冶	143,258,320.54	0.72
6	601988	中国银行	107,719,836.75	0.54
7	601166	兴业银行	105,044,848.53	0.53
8	601601	中国太保	82,455,448.68	0.41
9	600005	武钢股份	81,611,384.31	0.41
10	601766	中国南车	77,818,134.42	0.39
11	600104	上海汽车	74,586,966.59	0.37
12	601328	交通银行	72,523,202.28	0.36
13	601088	中国神华	71,015,031.48	0.36
14	601186	中国铁建	68,473,869.01	0.34
15	600519	贵州茅台	64,667,106.01	0.32
16	600019	宝钢股份	54,720,995.55	0.27
17	600550	天威保变	46,372,916.18	0.23
18	601628	中国人寿	43,576,704.64	0.22
19	601939	建设银行	34,114,043.24	0.17
20	600016	民生银行	33,740,775.21	0.17

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	2,836,857,459.75
卖出股票收入(成交)总额	2,043,934,922.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各