兴和证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华夏兴和封闭
基金主代码	500018
交易代码	500018
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年 7 月 14 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000 份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年 7 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用指数化投资方法和积极的投资运作,力求基金收益率超越我国证券市场的指数增长率(以中证 100 指数为参考),谋求基金资产长期增值。
投资策略	本基金资产在指数化投资、积极投资、债券投资中进行适当分配,谋求较低风险下的稳定收益。
业绩比较基准	本基金未规定业绩比较基准。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853

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	60,547,726.56
本期利润	-159,075,749.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0530
本期基金份额净值增长率	-4.99%
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	0.0311
期末基金资产净值	3,104,432,151.91
期末基金份额净值	1.0348

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	0.78%	2.07%	-	-	-	-
过去三个月	-4.83%	1.91%	-	-	-	-
过去六个月	-4.99%	1.71%	-	-	-	-
过去一年	8.78%	1.86%	-	-	-	-
过去三年	16.12%	2.84%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	335.52%	2.60%	-	-	-	-

注:本基金未规定业绩比较基准。

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

兴和证券投资基金

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

(1999 年 7 月 14 日至 2011 年 6 月 30 日)

注:本基金未规定业绩比较基准。

§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		
阳琨	本基金的基金经理	2009-01-01	-	16年	北京大学 MBA,曾任宝盈基金管理有限公司基金经理助理,益民基金管理有限公司投资部部门经理,中国对外经济贸易信托投资公司财务部部门经理。2006 年加入华夏基金管理有限公司,历任策略研究员。

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,国内通货膨胀压力依然较大,为抑制通胀,央行持续通过加息并多次提高存款准备金率来收缩流动性,同时,政府还推出了一系列行政措施对终端价格实施管制,但是由于本轮通胀成因较为复杂,控制通胀的难度较大。上半年 CPI 同比上涨了 5.4%,仍超出政策调控目标。持续紧缩的货币政策造成实体经济资金面紧张,引发了投资者对于经济下滑的担忧。

市场方面,由于投资者对经济前景难以形成一致预期,A 股市场呈现冲高回落、区间震荡的走势,具体而言:由于大盘蓝筹股估值修复的推动,上证指数在 4 月初冲高至 3067 点,其后持续下跌,到 6 月中下旬低见 2611 点。其中,以创业板指数为代表的高估值小盘股大幅下跌,而低估值的大盘蓝筹股防御性较强。

报告期内,本基金积极投资部分保持了较高的股票仓位,超配了代表经济转型方向的大消费行业。然而,重仓的医药、商贸等行业虽然长期前景良好,但由于短期估值水平较高,在市场波动中表现不佳,给基金净值造成一定的影响。

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 1.0348 元,本报告期份额净值增长率为-4.99%,同期上证综指下跌 1.64%,深证成指下跌 2.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为 CPI 在创出阶段性高点后或将逐步回落,通胀失控的可能性较小,紧缩性的货币政策可能会有所缓和,但通胀的隐忧仍会在较长时间内困扰投资者。从长期来看,中国经济可能处于一个温和减速的通道中,产业转型是国家的既定方针,也是市场投资者需要高度重视的方向。我们认为,消费和新兴行业在消化了前期的估值泡沫后,仍有可能是投资者寻找成长性的主要领域。

本基金积极投资部分将继续实施“自下而上”的投资策略,将投资的眼光放得更长远,力图挑选出能够跨越周期成长的个股,把握结构性的投资机会,力图实现超越指数的回报。

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

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金 2010 年度需实施利润分配,分配比例不得低于基金年度可分配收益的 90%。本基金已遵循基金合同的有关规定,于 2011 年 4 月向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 1.05 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 315,000,002.37 元。

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

本托管人复核审查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。

§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:兴和证券投资基金

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		86,804,876.23	302,763,605.76
结算备付金		1,577,537.11	1,848,647.53
存出保证金		4,097,635.52	3,614,423.85
交易性金融资产		3,040,602,615.79	3,391,526,724.81
其中:股票投资		2,352,203,253.09	2,647,812,061.11
基金投资		-	-
债券投资		688,399,362.70	743,714,663.70
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		-	18,876,000.00
应收利息		4,698,446.41	11,792,439.34
应收股利		1,713,110.94	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		5,000.00	5,000.00
资产总计		3,139,499,222.00	3,730,426,841.29
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		-	114,879,042.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,130,919.67	3,834,560.60
应付托管费		626,183.95	766,912.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		28,926,469.51	30,153,279.80
应交税费		930,642.68	930,642.68
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,452,854.28	1,354,500.00
负债合计		35,067,070.09	151,918,937.43
所有者权益:			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		104,432,151.91	578,507,903.86
所有者权益合计		3,104,432,151.91	3,578,507,903.86
负债和所有者权益总计		3,139,499,222.00	3,730,426,841.29

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.0348 元,基金份额总额 3,000,000,000 份。

6.2 利润表

会计主体:兴和证券投资基金

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		-129,780,798.44	-663,957,352.30
1.利息收入		12,599,271.11	11,282,395.63
其中:存款利息收入		627,119.83	860,389.79
债券利息收入		11,964,762.03	10,422,005.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,389.25	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		77,241,303.90	166,634,715.30
其中:股票投资收益		66,644,855.78	155,844,378.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-8,635,369.56	-1,791,203.02
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		19,231,817.68	12,581,540.21
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-219,623,476.14	-841,874,463.23
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,102.69	-
减:二、费用		29,294,951.14	32,995,919.43
1.管理人报酬		20,957,735.60	22,381,040.28
2.托管费		4,191,547.10	4,476,208.05
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,803,265.09	3,055,436.59
5.利息支出		181,249.44	1,242,260.28
其中:卖出回购金融资产支出		181,249.44	1,242,260.28
6.其他费用		1,161,153.91	1,840,974.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-159,075,749.58	-696,953,271.73
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-159,075,749.58	-696,953,271.73

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴和证券投资基金

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)	3,000,000,000.00	578,507,903.86	3,578,507,903.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-159,075,749.58	-159,075,749.58
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-315,000,002.37	-315,000,002.37
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	104,432,151.91	3,104,432,151.91
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	1,362,255,323.38	4,362,255,323.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-696,953,271.73	-696,953,271.73
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-540,000,000.00	-540,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	125,302,051.65	3,125,302,051.65

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	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	598,553,179.56	33.61%	204,320,997.32	10.64%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	101,591,224.70	40.77%	923,232,032.90	86.90%

6.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	190,000,000.00	100.00%	2,407,000,000.00	90.74%

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	508,767.83	34.23%	2,579,486.60	8.92%
关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	173,671.21	11.44%	1,641,482.23	5.81%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.4.2 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	20,957,735.60	22,381,040.28

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 1.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。本基金成立三个月后,若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%,超出部分不计提基金管理费。

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 × 1.25% / 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	4,191,547.10	4,476,208.05

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 0.25%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 × 0.25% / 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

单位:人民币元

本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	49,920,582.97	-	-	259,350,000.00	90,028.25

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

份额单位:份

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	165,089,737.00	165,089,737.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	165,089,737.00	165,089,737.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.50%	5.50%

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
中国建设银行	86,804,876.23	605,695.60	71,220,057.84	832,105.88

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	600036	招商银行	配股发行	1,367,959	12,106,437.15
中信证券	601166	兴业银行	配股发行	184,982	3,329,676.00

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

金额单位:人民币元

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000882	华联股份	2011-01-13	2012-01-14	非公开发行流通受限	6.60	6.96	2,860,000	18,876,000.00	19,905,600.00	-

6.4.5.2 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
600098	广州控股	2011-06-20	控股股东筹划涉及公司的重大事项	6.79	2011-07-08	7.47	1,000,000	8,706,872.73	6,790,000.00	-

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	2,352,203,253.09	74.92
	其中:股票	2,352,203,253.09	74.92
2	固定收益投资	688,399,362.70	21.93
	其中:债券	688,399,362.70	21.93
	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	88,382,413.34	2.82
6	其他各项资产	10,514,192.87	0.33
7	合计	3,139,499,222.00	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	-	-
B	采掘业	155,651,891.18	5.01
C	制造业	261,160,274.59	8.41
C0	食品、饮料	66,782,048.76	2.15
C1	纺织、服装、皮毛	5,247,938.22	0.17
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,638,492.94	0.92
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	59,911,186.69	1.93
C7	机械、设备、仪表	100,580,607.98	3.24
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	25,380,591.43	0.82
E	建筑业	10,700,406.24	0.34
F	交通运输、仓储业	46,290,287.12	1.49
G	信息技术业	29,739,811.36	0.96
H	批发和零售贸易	21,750,534.54	0.70
I	金融、保险业	412,654,821.13	13.29
J	房地产业	42,684,401.30	1.37
K	社会服务业	8,881,719.77	0.29
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,712,649.00	0.18
	合计	1,020,607,387.66	32.88

7.2.2 积极投资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	25,728,976.64	0.83
B	采掘业	26,194,884.86	0.84
C	制造业	612,252,611.84	19.72
C0	食品、饮料	127,628,832.76	4.11
C1	纺织、服装、皮毛	26,170,819.32	0.84
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	43,689,229.94	1.41
C5	电子	58,139,390.36	1.87
C6	金属、非金属	76,519,723.86	2.46
C7	机械、设备、仪表	53,775,578.26	1.73
C8	医药、生物制品	200,940,193.58	6.47
C99	其他制造业	25,388,843.76	0.82
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,790,000.00	0.22
E	建筑业	16,819,030.32	0.54
F	交通运输、仓储业	32,639,880.64	1.05
G	信息技术业	46,212,545.36	1.49
H	批发和零售贸易	170,865,198.43	5.50
I	金融、保险业	206,435,325.54	6.65
J	房地产业	129,343,601.43	4.17
K	社会服务业	19,231,004.40	0.62
L	传播与文化产业	8,686,452.05	0.28
M	综合类	30,396,353.92	0.98
	合计	1,331,595,865.43	42.89

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	9,556,828	124,429,900.56	4.01
2	601318	中国平安	1,363,059	65,794,857.93	2.12
3	600016	民生银行	10,447,260	59,862,799.80	1.93
4	600000	浦发银行	5,021,688	49,413,409.92	1.59
5	600519	贵州茅台	170,292	36,209,187.96	1.17
6	601088	中国神华	1,181,222	35,602,031.08	1.15
7	000002	万 科 A	3,853,756	32,564,238.20	1.05
8	601166	兴业银行	1,997,802	26,930,370.96	0.87
9	600585	海螺水泥	937,401	26,022,251.76	0.84
10	000651	格力电器	1,089,855	25,611,592.50	0.83

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。

7.3.2 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前五名股票投资明细

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	7,420,000	96,608,400.00	3.11
2	000423	东阿阿胶	2,007,599	82,833,534.74	2.67
3	600694