

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2011年8月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不表示其未来表现,投资者风险自担,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

2.2 基金产品说明

投资目标: 本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序和数量化风险管理手段,力求跟踪标的指数投资偏差度和跟踪误差的最小化。

投资策略: 本基金采用完全复制策略,按照成份股在中证100指数中的权重构建指数化投资组合。

业绩比较基准: 中证100指数收益率\*95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)\*5%

风险收益特征: 本基金为股票型指数基金,可获取本市场平均收益率,其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Includes names like 陈勇, 赵会军 and contact info.

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.fundfund.com.cn
基金半年度报告置地点: 深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 报告期末(2011年1月1日至2011年6月30日), 本报告期末(2011年6月30日).

注:①上列基金业绩指标不包括持有人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期末可供分配利润是采用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。

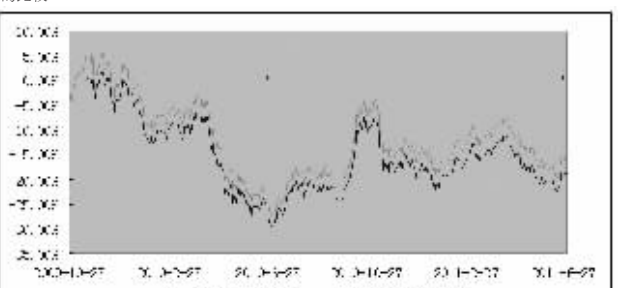
3.2 基金净值表现

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

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的偏差②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④.

注:本基金的业绩比较基准为:中证100指数收益率\*95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)\*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



§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

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]132号文批准,公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司、公司注册资本为1.5亿元人民币。

4.1.2 基金经理 倪基金理小组 及基金经理助理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 从业年限. Lists 王坚, 王亚伟, etc.

注:①此处的任职日期为诺安中证100指数证券投资基金基金合同生效之日;

②基金经理的从业年限从证券业从业人员资格管理办法的相关规定起算;

③基金经理在报告期内未发生管理期间可追认的违规行为。

报告期内,诺安中证100指数证券投资基金基金管理人,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司内部控制制度,本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 异常交易行为的专项说明

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,并根据《证券投资基金管理人公平交易管理制度指导意见》确定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.2 本投资组合与基金投资组合的业绩比较
本基金管理人旗下没有与本基金投资组合风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金不存在异常交易情况。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2011年上半年,A股市场整体先扬后抑,一季度逐步走高,二季度单边大幅下跳。更显著的是,我们预期的风格切换在不知不觉间已经展开,大小盘风格指数的表现差异巨大。蓝筹个股跌幅较大,而中小板、创业板整体跌幅巨大。蓝筹指数以中证100指数为例,仅下跌4.49%;而中小盘指数则下跌了14.8%,创业板指数下跌了25.64%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.815元,本报告期基金份额净值增长率为-0.12%,同期业绩比较基准收益率为-0.37%,跟踪误差为0.25%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
我们认为目前中国经济有以下几个显著的特点:

1) 高通胀-高利率-高成长:上半年CPI在六月份创出新高6.4%,但经济在上半年仍实现了9.6%的增长,表明经济增长实际上实现了软着陆,消除了最可怕的滞胀威胁,另外高通胀从数据上将从从7月或8月份起拐头,使得进一步的紧缩政策没有必要。

2) 外需逐步走弱,但国内投资和消费依然保持较快的增长水平,所以虽然欧美市场潜在的金风险,但包括美国在内的美国国债透支支付与削减财政支出,可能进一步扩散并影响实体经济,但当前美国,中国由之前进行了调控,其经济受影响程度可能并不大,另外经济的增长动力正在发生变化,以投资驱动向地产投资为例,商品房投资的减少完全被保障性住房所弥补并超过,而通过中小板、创业板融资促进了新兴产业的崛起,这些产业在未来几年将成长为经济又一增长点。

3) 在成本快速上升(原材料、人工、资金)的巨大压力下,许多行业的企业集中度在不断提高,龙头企业将集中资源,这实际上会提高经济增长的质量,比如典型的是房地产业,在面临超高的融资成本、通胀成本、限售等等诸多不利因素下,行业增速有限,但龙头企业仍实现了非常高的销售和利润增长。

综上所述,在通胀将下降,国内经济持续较快增长,行业集中度提高的大背景下,我们有理由继续看好中证100指数,并认为其是分散投资于各个行业的龙头公司。目前中证100指数较2011年5月的预期指数计算PE估值约为10倍,而且在经济平稳发展的前提下,该指数未来三年的预期复合增长率保守估计至少有5%,因此可以说是低风险投资。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金估值有关的事项的通知》,与独立于基金管理人及基金托管人之外,具备独立估值能力的估值服务机构按照合同约定的,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布,月末、年中净值估值复核与基金会计核算账务同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务部、稽核复核部和风险管理部人员、固定收益人员及基金经理组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值工作由估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有表决权发表有关议案。

4.7 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金估值有关的事项的通知》,与独立于基金管理人及基金托管人之外,具备独立估值能力的估值服务机构按照合同约定的,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布,月末、年中净值估值复核与基金会计核算账务同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务部、稽核复核部和风险管理部人员、固定收益人员及基金经理组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值工作由估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有表决权发表有关议案。

4.8 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金估值有关的事项的通知》,与独立于基金管理人及基金托管人之外,具备独立估值能力的估值服务机构按照合同约定的,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布,月末、年中净值估值复核与基金会计核算账务同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务部、稽核复核部和风险管理部人员、固定收益人员及基金经理组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值工作由估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有表决权发表有关议案。

4.9 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金估值有关的事项的通知》,与独立于基金管理人及基金托管人之外,具备独立估值能力的估值服务机构按照合同约定的,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布,月末、年中净值估值复核与基金会计核算账务同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务部、稽核复核部和风险管理部人员、固定收益人员及基金经理组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值工作由估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调整某一投资品种的估值调整影响,并有表决权发表有关议案。

诺安中证100指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未参与与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.8 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.9 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.10 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.11 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.12 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.13 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.14 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.15 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.16 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.17 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.18 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.19 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.20 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.21 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.22 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.23 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.24 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.25 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.26 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.27 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.28 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.29 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.30 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.31 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.32 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.33 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.34 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.35 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.36 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.37 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.38 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.39 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.40 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.41 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.42 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.43 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.44 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.45 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.46 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.47 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.48 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.49 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.50 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.51 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.52 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.53 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.54 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.55 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.56 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.57 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.58 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.59 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.60 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.61 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.62 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.63 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.64 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.65 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.66 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.67 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.68 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.69 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.70 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

4.71 基金管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为六次,每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

6.4.4.1.3 支付关联方的佣金
本基金本报告期及上年度可比期间不存在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

Table with 3 columns: 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).

注:A. 基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%的年费率计提,计算方法如下:
H=0.75%\*当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值

B. 基金管理费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 3 columns: 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).

注:A. 基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提,计算方法如下:
H=0.15%\*当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日基金资产净值

B. 基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付。

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与关联方无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 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

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
本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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

Table with 3 columns: 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).

6.4.4.6 本基金在承销期间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承销期间内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明
6.4.4.7.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.4.7.2 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
本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.4.7.3 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

Table with 3 columns: 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).

6.4.4.7.4 本基金在承销期间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承销期间内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7.5 其他关联交易事项的说明
6.4.