中海量化策略股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十六日

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(以下简称"工商银行")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。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	398041
交易代码	398041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
基金管理人	中海基金管理有限公司
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	708,698,436.68份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	根据量化模型,精选个股,积极配置权重,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上,通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置,动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。 股票投资:本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略,施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。 债券投资:债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的,在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上,采取积极主动的投资策略,投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品,在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得,谋取超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

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		中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	赵会军
	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788.021-38789788	95588
传真		021-68419525	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.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

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	1,396,557.73
本期利润	-32,099,102.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0484
本期基金份额净值增长率	-3.16%
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	0.0360
期末基金资产净值	734,207,075.32
期末基金份额净值	1.036

注1:本基金合同于2009年6月24日生效。

注2:以上所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注3: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

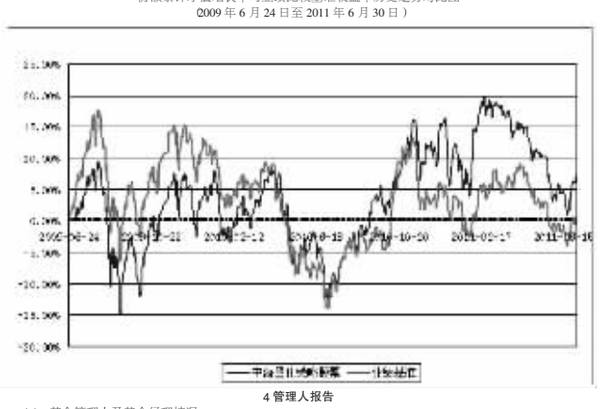
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.29%	1.03%	1.07%	0.96%	2.22%	0.07%
过去三个月	-5.22%	0.93%	-4.35%	0.88%	-0.87%	0.05%
过去六个月	-3.16%	1.12%	-1.82%	0.99%	-1.34%	0.13%
过去一年	19.97%	1.23%	15.09%	1.12%	4.88%	0.11%
自基金合同生效起至今	7.24%	1.43%	0.64%	1.33%	6.60%	0.10%

注1:"自基金合同生效起至今"指2009年6月24日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

注2:本基金的业绩比较基准为沪深300指数涨跌幅*80%+中国债券总指数涨跌幅*20%,我们选取市场认同度很高的沪深300指数、中国债券总指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为60%-95%,在一般市场状况下,本基金股票投资比例会控制在80%左右,债券投资比例控制在20%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重,以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照80%、20%的比例对基础指数进行再平衡,然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

中海量化策略股票型证券投资基金
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
(2009年6月24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

基金管理人自2004年3月18日成立以来,始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行基金管理人的责任和义务,依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系,为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至2011年6月30日,共管理开放式证券投资基金10只。

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		
李延刚	本公司副总经理,本基金基金经理	2009-06-24	-	10	李延刚先生,加拿大国籍。南京大学学士,加拿大西蒙弗雷泽大学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任中储发展股份有限公司海外业务发展助理、业务发展经理、战略发展总监,伦敦资产管理有限公司投资顾问、基金经理。2007年7月进入本公司工作,历任投资管理部副总经理、投研中心总经理。2009年4月至今任本公司副总经理。2008年1月至2009年6月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理,2008年4月至2009年6月任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理,2009年6月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

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。

注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

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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

为进一步完善公平交易管理,防范和杜绝不规范交易行为,保护基金份额持有人的合法权益,公司建立了有纪律、规范的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

公司通过制定《中海基金研究报告质量考评制度》,树立了研究导向的投资文化,强调投资应以研究作为依据,不断建立完善系统、科学的研究方法和流程,并认真地推行实施。

对于场内交易,公司制定了《中海基金管理有限公司交易管理制度》,所有的投资指令必须通过集中交易室下达,集中交易室与投资部门相隔离,规定多基金指令处理原则是:时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡,通过公司已有交易软件进行控制,不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配,同时禁止多基金之间的同日反向交易。对于场外交易,通过《固定收益证券投资管理办法》、《新股询价网下申购流程》以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对交易行为进行规范。

本报告期,不同投资组合的交易得到公平对待,未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本报告期,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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季度大盘先跌后涨。1月,由于市场担心CPI持续走高从而触发了对政策持续紧缩的预期,大盘几乎单边下跌,中小盘股票下跌猛烈。2月,由于发布的CPI低于预期且政策面资金面相对宽松,市场整体呈现上行趋势。3月,大盘总体震荡上行,在上行至3000点附近时,市场受到加息预期的影响出现回调,在日本大地震发生后,市场进一步下挫,随后在央行宣布提高准备金后,市场企稳反弹。

2季度市场几乎单边下跌。基于对通胀预期的管理,不断走高的CPI带来了持续的提高存款准备金和加息,从而使得资本市场的流动性发生了较大的变化,从而带来大盘的持续下跌,尤其是小盘股和创业板下跌严重。

回顾上半年的操作,量化基金依照稳健的投资策略,取得了相对较好的成效。在模型的提示下,量化基金先是在一月底2700点附近进行了加仓,并配置了低估值的品种,并于4月初在模型的提示下进行了减仓,而且在配置上加强了对消费品的布局。量化基金依据模型提示,进行了数次适度减仓。6月,量化基金在大盘下跌到2620点附近,依据模型提示的信号,果断进行了较大幅度的加仓。

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1.036元(累计净值1.073元)。报告期内本基金净值增长率为-3.16%,低于业绩比较基准1.34个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,基于市场一致预期,紧缩政策接近尾声,中国经济将企稳上行,通胀将逐步下行,加上半年报的不断公布,具有明显估值优势的各类板块股票和半年报能够超预期的成长股将会有表现。我们将继续优化我们的数量化模型,结合大类资产配置模型,量化行业配置模型,量化风格轮动模型和数量化选股模型,积极把握三季度的各种机会,以期在三季度较好的把握市场给我们创造的各类机会。

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估值核算小组,组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等,成员均具有多年基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理,但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。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

根据法律法规以及本基金合同的相关规定,本基金于2011年3月7日实施了利润分配,实际分配金额为11,372,914.93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

2011年上半年,本基金托管人在对中海量化策略股票型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,中海量化策略股票型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海量化策略股票型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,中海量化策略股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为11,372,914.93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

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海量化策略股票型证券投资基金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:中海量化策略股票型证券投资基金

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		126,901,643.38	52,798,829.32
结算备付金		1,913,476.90	5,143,487.44
存出保证金		1,619,252.46	1,868,534.53
交易性金融资产		623,812,928.46	545,175,300.27
其中:股票投资		623,812,928.46	545,175,300.27
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		-	2,964,576.64
应收利息		27,287.40	10,867.33
应收股利		-	-
应收申购款		598,217.64	219,209.08
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		754,872,806.24	608,180,804.61
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		18,096,316.97	6,602,225.97
应付赎回款		152,983.73	245,696.15
应付管理人报酬		865,778.10	809,479.65
应付托管费		144,296.35	134,913.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,187,887.05	2,067,108.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		218,468.72	100,555.64
负债合计		20,665,730.92	9,959,979.43
所有者权益:			
实收基金		708,698,436.68	551,646,704.85
未分配利润		25,508,638.64	46,574,120.33
所有者权益合计		734,207,075.32	598,220,825.18
负债和所有者权益总计		754,872,806.24	608,180,804.61

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.036元,基金份额总额708,698,436.68份。

6.2 利润表

会计主体:中海量化策略股票型证券投资基金

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		-20,805,221.13	-97,176,605.97
1.利息收入		634,156.96	835,235.33
其中:存款利息收入		634,156.96	835,235.33
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)		11,851,304.45	-4,994,274.02
其中:股票投资收益		9,705,229.07	-6,847,230.88
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		2,146,075.38	1,852,956.86
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-33,495,660.11	-93,804,447.16
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		204,977.57	786,879.88
减:二、费用		11,293,881.25	20,167,575.63
1.管理人报酬		5,311,208.99	7,889,339.90
2.托管费		885,201.52	1,314,890.02
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,889,656.05	10,708,256.68
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		207,814.69	255,089.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-32,099,102.38	-117,344,181.60
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-32,099,102.38	-117,344,181.60

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海量化策略股票型证券投资基金

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)	551,646,704.85	46,574,120.33	598,220,825.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,099,102.38	-32,099,102.38
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)	157,051,731.83	22,406,535.62	179,458,267.45
其中:1.基金申购款	355,446,667.23	46,000,309.96	401,446,977.19
2.基金赎回款	-198,394,935.40	-23,593,774.34	-221,988,709.74
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)	-	-11,372,914.93	-11,372,914.93
五、期末所有者权益(基金净值)	708,698,436.68	25,508,638.64	734,207,075.32
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)	1,309,863,099.51	54,313,423.04	1,364,176,522.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-117,344,181.60	-117,344,181.60
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)	-514,585,224.25	-16,545,906.05	-531,131,130.30
其中:1.基金申购款	97,248,251.71	1,455,448.34	98,703,700.05
2.基金赎回款	-611,833,475.96	-18,001,354.39	-629,834,830.35
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)	-	-19,589,923.42	-19,589,923.42
五、期末所有者权益(基金净值)	795,277,875.26	-99,166,588.03	696,111,287.23

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:宋宇,主管会计工作负责人:宋宇,会计机构负责人:曹伟

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中海量化策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")由中海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》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]347号《关于核准中海量化策略股票型证券投资基金募集的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2009年6月24日生效,该日的基金份额总额为1,646,387,741.58份。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、本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

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

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

本基金在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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

6.4.6.1

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

6.4.6.2

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

6.4.6.3

对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

6.4.6.4

基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6.5

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、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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未发生变化。

6.4.7.2 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
中海基金管理有限公司(中海基金")	基金管理人、直销机构
工商银行	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司(国联证券")	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未在关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未在关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未在关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未在关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	5,311,208.99	7,889,339.90
其中:支付销售机构的客户维护费	626,745.37	1,036,152.15

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数(H为每日应支付的基金管理费,E为前一日的基金资产净值)

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.8.2.2 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	885,201.52	1,314,890.02

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数(H为每日应支付的基金托管费,E为前一日的基金资产净值)

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间市场交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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
工商银行	126,901,643.38	598,658.39	333,930,374.38	793,197.36

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,并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 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
-	-	-	-	-	-
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
国联证券	002419	天虹商场	分销	1,000	40,000.00
国联证券	002444	巨星科技	分销	1,000	29,000.00
国联证券	300094	国联水产	分销	500	7,190.00

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额,因此无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额,因此无抵押债券。

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	623,812,928.46	82.64
	其中:股票	623,812,928.46	82.64
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	128,815,120.28	17.06
6	其他各项资产	2,244,757.50	0.30
7	合计	754,872,806.24	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	-	-
B	采掘业	3,464,960.00	0.47
C	制造业	324,156,886.31	44.15
C0	食品、饮料	43,350,514.76	5.90
C1	纺织、服装、皮毛	7,686,163.64	1.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	19,094,093.25	2.60
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,647,758.39	3.90
C5	电子	12,715,533.07	1.73
C6	金属、非金属	27,297,684.67	3.72
C7	机械、设备、仪表	82,412,956.09	11.22
C8	医药、生物制品	102,952,182.44	14.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,535,190.39	4.57
F	交通运输、仓储业	39,851,880.80	5.43
G	信息技术业	42,495,452.37	5.79
H	批发和零售贸易	113,716,429.95	15.49
I	金融、保险业	21,140,895.00	2.88
J	房地产业	11,013,597.00	1.50
K	社会服务业	17,933,181.68	2.44
L	传播与文化产业	5,696,743.22	0.78
M	综合类	10,807,711.74	1.47
	合计	623,812,928.46	84.96

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	000061	农 产 品	4,099,921	65,434,739.16	8.91
2	000858	五 粮 液	804,773	28,746,491.56	3.92
3	300026	红日药业	901,093	24,032,150.31	3.27
4	600518	康美药业	1,667,300	21,941,668.00	2.99
5	600482	风帆股份	1,353,859	20,605,733.98	2.81
6	600502	安徽水利	1,110,829	17,673,289.39	2.41
7	600742	一汽富维	516,239	15,115,477.92	2.06
8	600009	上海机场	1,156,340	14,801,152.00	2.02
9	000869	张 裕 A	147,814	14,604,023.20	1.99
10	600276	恒瑞医药	451,859	13,542,214.23	1.84

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	000061	农 产 品	70,470,232.38	11.78
2	600482	风帆股份	66,008,110.43	11.03
3	600303	曙光股份	40,621,039.79	6.79
4	600125	铁龙物流	38,905,547.60	6.50
5	600456	宝钛股份	36,309,685.98	6.07
6	600589	广东榕泰	31,096,671.72	5.20
7	601088	中国神华	30,882,403.92	5.16
8	000858	五 粮 液	30,509,955.02	5.10
9	601601	中国太保	25,584,300.35	4.28
10	600009	上海机场	25,079,927.22	4.19
11	300026	红日药业	24,659,798.52	4.12
12	601688	华泰证券	24,507,238.39	4.10
13	600518	康美药业	23,971,959.42	4.01
14	000776	广发证券	23,487,389.42	3.93
15	002091	江苏国泰	23,270,948.01	3.89
16	600068	葛洲坝	22,451,176.68	3.75
17	600773	西藏城投	22,120,738.98	3.70
18	601666	平煤股份	21,858,389.83	3.65
19	600893	航空动力	19,808,898.56	3.31
20	600270	外运发展	18,840,171.36	3.15
21	000780	平庄能源	18,770,379.41	3.14
22	002208	合肥城建	17,508,246.49	2.93
23	000937	冀中能源	17,184,370.68	2.87
24	601169	北京银行	17,048,331.00	2.85
25	600038	哈飞股份	16,906,010.54	2.83
26	600502	安徽水利	16,714,903.61	2.79
27	002106	莱宝高科	16,297,447.97	2.72
28	601318	中国平安	15,505,655.64	2.59
29	002210	飞马国际	14,802,322.72	2.47
30	000627	天茂集团	14,644,822.26	2.45
31	601699	潞安环能	14,601,587.40	2.44
32	600276	恒瑞医药	14,546,759.80	2.43
33	600362	江西铜业	14,384,605.40	2.40
34	000963	华东医药	13,907,916.11	2.32
35	600742	一汽富维	13,690,513.07	2.29
36	000869	张 裕 A	13,678,968.09	2.29
37	000829	天音控股	13,572,044.16	2.27
38	002024	苏宁电器	13,383,469.20	2.24
39	000729	燕京啤酒	13,028,091.64	2.18
40	600523	贵航股份	13,016,633.84	2.18
41	600121	郑州煤电	12,815,301.38	2.14
42	601299	中国北车	12,756,057.00	2.13
43	600266	北京城建	12,586,656.31	2.10
44	600062	双鹤药业	12,585,176.74	2.10
45	000630	铜陵有色	12,