基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2011年8月26日

银华优势企业证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011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

基金名称	银华优势企业证券投资基金
基金简称	银华优势企业混合
基金主代码	180001
前端交易代码	180001
后端交易代码	180011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月13日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,935,073,354.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金,主要通过投资于中国加入WTO后具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行上市的债券,在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	坚持平衡原则:平衡收益与风险;平衡长期收益与短期收益;平衡股票与债券的投资;平衡成长型与价值型股票的投资。 本基金的资产配置比例:股票投资比例浮动范围为20-70%;债券投资比例浮动范围为20-70%;现金留存比例浮动范围为5-15%;投资证券的资产不低于基金总资产的80%;投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%。 基于大盘走势关系基金投资全局,本基金充分重视对各市场趋势尤其是对股市大盘趋势的研判,并因此将控制基金仓位放在资产配置和投资组合中的优先位置。 本基金资产配置采取自上而下的操作流程,而股票选择采取自下而上的操作流程。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信全债指数×20%+同业活期存款利率×10%。
风险收益特征	注重收益与风险的平衡,通过控制股票、债券的投资比重来获取中低风险下的中等收益。

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		银华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	唐州徽
	联系电话	010)58163000	010)66594855
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4006783333,010)85186558	95566
传真		010)58163027	010)66594942

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	http:/www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§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	72,433,130.90
本期利润	-108,709,775.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0361
本期加权平均净值利润率	-3.18%
本期基金份额净值增长率	-3.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	342,962,882.58
期末可供分配基金份额利润	0.1168
期末基金资产净值	3,278,036,236.85
期末基金份额净值	1.1168
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	307.59%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.82%	0.74%	0.94%	0.84%	0.88%	-0.10%
过去三个月	-1.91%	0.71%	-3.82%	0.77%	1.91%	-0.06%
过去六个月	-3.13%	0.83%	-2.02%	0.86%	-1.11%	-0.03%
过去一年	18.49%	1.00%	13.09%	0.97%	5.40%	0.03%
过去三年	21.99%	1.17%	12.97%	1.40%	9.02%	-0.23%
自基金合同生效日起至今	307.59%	1.17%	135.48%	1.29%	172.11%	-0.12%

注:中信标普300 包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大、最具流动性的300只股票并以流通股本加权的股票指数,是目前中国证券市场中与本基金股票投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数。本基金的股票投资比例范围为:20-70%,所以本基金加入20%的中信全债指数和10%的同业活期存款利率一起构成本基金的业绩比较基准。

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

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十八条:基金的投资(二)投资对象及投资范围、(四)投资组合中规定的各项比例,本基金股票投资比例浮动范围:20-70%;债券投资比例浮动范围:20-70%;现金留存比例浮动范围:5-15%;投资证券的资产比例不低于基金总资产的80%;投资于国债的比例不低于基金资产净值的20% 。

§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

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性基金管理公司。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股权结构为西南证券股份有限公司(出资比例:29%)、第一创业证券有限责任公司(出资比例:29%)、东北证券股份有限公司(出资比例:21%)及山西海鑫实业股份有限公司(出资比例:21%)。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至2011年6月30日,本基金管理人管理着十九只开放式证券投资基金和一只创新型封闭式证券投资基金,包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金(LOF)、银华深证100指数分级证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金和银华信用债券型证券投资基金。

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		
金斌先生	本基金的基金经理。	2009年2月18日	-	8年	硕士,曾在国泰君安证券股份有限公司从事行业研究工作。2004年8月加盟银华基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、研究主管及研究部总监等职。具有从业资格。国籍:中国。
廖平先生	本基金的基金经理。	2011年5月11日	-	9年	经济学硕士。2001年5月加盟银华基金管理有限公司,曾任行业研究员及银华优势企业证券投资基金基金经理助理职务。具有从业资格。国籍:中国。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华优势企业证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,本基金管理人制定并执行了公平交易制度。公平交易制度的范围包括所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动。公平交易的执行情况包括:公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有公平的机会;实行集中交易制度和公平的交易分配制度;加强对投资交易行为的监察稽核力度等。综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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

注:本基金管理人旗下无其他投资风格与本基金相似的投资组合,因此未进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2011年上半年,在通货膨胀及货币政策收紧的压力下,再加上许多股票并没有表现出市场预期的成长性,以创业板为代表的高估值板块经历了显著的调整,而许多传统行业的优质股票则迎来了价值回归。中小板指数下跌15%,创业板指数下跌26%,而沪深300指数仅下跌3%。

由于一直以来担心市场对所谓高成长股票的过分追捧,2011年上半年,我们重点投资了家电、食品饮料等行业优质个股,这些配置都为投资组合的业绩做出了正贡献。但由于部分重仓股面临市场竞争环境变化等不利因素,业绩不达预期,拖累了组合的业绩表现。

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1.1168元,本报告期份额净值增长率为-3.13% ,同期业绩比较基准增长率为-2.02%。

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,一方面通胀的压力仍较大,另外一方面经济增速面临回落风险,这对政府智慧是一个考验。近几年以来,随着房地产价格暴涨,货币的保值功能可能逐渐失去,如果政策重新回到放松的老路上去,通胀将面临失控的风险。

从目前的形势来看,政府对通胀的容忍度正在提高,宏观调控政策也有要部分放松的迹象。对于投资人来讲,这也是一个挑战:如果中央政府对收紧货币的决心开始动摇,我们要不要参与一波可能的市场反弹?

面对宏观层面的不确定性,我们的策略是坚持自下而上的选股。以一个更加谨慎的选股标准,来抵抗市场系统性的风险。我们希望选择那些经过历史考验的公司,要求管理层诚信进取、企业竞争能力优秀、且具有估值优势的企业。我们的目标是把下行风险控制在一个可以忍受的程度上,为投资者获取一定的收益。

4.6 管理人对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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同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、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干),负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务;估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于2011年2月21日发布分红公告向截至2011年2月23日止本基金登记在册的份额持有人,按每10份基金份额分配红利人民币0.30元,实际分配收益金额为人民币92,182,386.06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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对银华优势企业证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的"金融工具风险管理"部分未在托管人复核范围内。)

§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:银华优势企业证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	400,667,302.00	257,992,274.96
结算备付金	1,843,331.01	4,908,454.51
存出保证金	1,707,572.07	1,535,377.86
交易性金融资产	2,861,252,675.95	3,387,674,703.54
其中:股票投资	1,980,111,041.05	2,471,833,320.66
基金投资	-	-
债券投资	881,141,634.90	915,841,382.88
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	9,355,644.56	-
应收利息	14,172,742.45	9,772,752.11
应收股利	-	-
应收申购款	706,092.29	988,356.46
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,289,705,360.33	3,662,871,919.44
负债和所有者权益	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	-	4,640,620.68
应付赎回款	4,982,642.15	5,330,174.94
应付管理人报酬	3,990,699.23	4,731,178.29
应付托管费	665,116.53	788,529.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,008,555.59	2,377,167.63
应交税费	60,187.20	60,187.20
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	961,922.78	856,305.36
负债合计	11,669,123.48	18,784,163.84
所有者权益:		
实收基金	2,935,073,354.27	3,078,768,776.45
未分配利润	342,962,882.58	565,318,979.15
所有者权益合计	3,278,036,236.85	3,644,087,755.60
负债和所有者权益总计	3,289,705,360.33	3,662,871,919.44

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.1168元,基金份额总额2,935,073,354.27份。

6.2 利润表

会计主体:银华优势企业证券投资基金

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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入	-75,320,609.17	-564,005,617.24
1.利息收入	13,391,415.48	15,204,291.02
其中:存款利息收入	1,106,617.50	1,412,286.79
债券利息收入	12,284,797.98	13,780,125.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	11,879.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	92,313,334.01	228,310,718.71
其中:股票投资收益	91,000,050.99	227,132,351.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,635,515.34	-7,833,830.61
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,948,798.36	9,012,197.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-181,142,906.17	-807,618,441.96
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	117,547.51	97,814.99
减:二、费用	33,389,166.10	46,401,939.72
1.管理人报酬	25,501,947.48	29,319,168.39
2.托管费	4,250,324.61	4,886,528.04
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,423,505.96	11,984,283.63
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	213,388.05	211,959.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-108,709,775.27	-610,407,556.96
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-108,709,775.27	-610,407,556.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华优势企业证券投资基金

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)	3,078,768,776.45	565,318,979.15	3,644,087,755.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-108,709,775.27	-108,709,775.27
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)	-143,695,422.18	-21,463,935.24	-165,159,357.42
其中:1.基金申购款	182,597,617.04	26,545,758.91	209,143,375.95
2.基金赎回款	-326,293,039.22	-48,009,694.15	-374,302,733.37
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)	-	-92,182,386.06	-92,182,386.06
五、期末所有者权益(基金净值)	2,935,073,354.27	342,962,882.58	3,278,036,236.85

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)	3,757,512,663.85	552,506,894.59	4,310,019,558.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-610,407,556.96	-610,407,556.96
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)	-175,134,613.23	-21,106,160.67	-196,240,773.90
其中:1.基金申购款	139,772,845.80	12,150,152.57	151,922,998.37
2.基金赎回款	-314,907,459.03	-33,256,313.24	-348,163,772.27
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)	-	-36,930,784.66	-36,930,784.66
五、期末所有者权益(基金净值)	3,582,378,050.62	-115,937,607.70	3,466,440,442.92

注: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:

_____王立新_____ _____陈建军_____ _____龚飒_____

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

本报告期财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

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。

6.4.3.2 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
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券有限责任公司(“第一创业”)	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注:以下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
西南证券	174,381,745.02	8.24%	-	-
第一创业	108,218,219.02	5.11%	88,586,013.36	1.13%
东北证券	103,180,731.34	4.87%	823,502,033.59	10.53%

6.4.4.1.2债券交易

注:本基金于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。

6.4.4.1.3债券回购交易

注:本基金于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回购交易。

6.4.4.1.4权证交易

注:本基金于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。

6.4.4.1.5 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
第一创业	87,928.36	4.98%	54,841.71	5.44%
东北证券	87,703.08	4.97%	87,703.08	8.70%
西南证券	143,228.12	8.11%	-	-
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
第一创业	71,976.52	1.11%	-	-
东北证券	699,972.62	10.76%	-	-

注:(1)上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等)。

(2)该类佣金协议的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	25,501,947.48	29,319,168.39
其中:支付销售机构的客户维护费	1,718,053.02	1,969,582.58

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

基金管理人的管理费每日计算,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

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	4,250,324.61	4,886,528.04

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;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取。

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

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(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

注:本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于2011年6月30日及2010年12月31日均未持有本基金份额。

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
中国银行	400,667,302.00	1,087,849.34	310,432,059.40	1,362,044.36

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

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

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
600315	上海家化	2010年12月6日	重大重组事项	36.88	未知	未知	4,996	161,725.83	184,252.48	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	1,980,111,041.05	60.19
	其中:股票	1,980,111,041.05	60.19
2	固定收益投资	881,141,634.90	26.78
	其中:债券	881,141,634.90	26.78
	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	402,510,633.01	12.24
6	其他各项资产	25,942,051.37	0.79
7	合计	3,289,705,360.33	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	66,310,471.48	2.02
C	制造业	1,193,707,798.24	36.42
C0	食品、饮料	369,910,233.91	11.28
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	184,252.48	0.01
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	97,088,281.24	2.96
C7	机械、设备、仪表	670,257,092.41	20.45
C8	医药、生物制品	56,267,938.20	1.72
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,916,857.32	1.34
H	批发和零售贸易	232,659,693.50	7.10
I	金融、保险业	353,337,873.51	10.78
J	房地产业	35,902,728.40	1.10
K	社会服务业	54,275,618.60	1.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,980,111,041.05	60.41

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	002073	软控股份	12,976,935	267,324,861.00	8.16
2	601318	中国平安	5,483,687	264,697,571.49	8.07
3	000651	格力电器	8,500,000	199,750,000.00	6.09
4	600519	贵州茅台	699,961	148,832,707.43	4.54
5	000858	五粮液	4,000,070	142,882,500.40	4.36
6	000527	美的电器	7,500,139	137,927,556.21	4.21
7	002024	苏宁电器	8,000,000	102,480,000.00	3.13
8	600016	民生银行	12,000,082	68,760,469.86	2.10
9	601088	中国神华	2,200,082	66,310,471.48	2.02
10	002032	苏泊尔	2,200,033	49,984,749.76	1.52

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票信息,应阅读登载于http:/www.yhfund.com.cn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名的股票投资明细

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	65,710,782.68	1.80
2	601088	中国神华	64,386,304.07	1.77
3	000527	美的电器	61,690,442.76	1.69
4	600519	贵州茅台	58,093,617.88	1.59
5	601318	中国平安	57,372,817.39	1.57
6	002032	苏泊尔	54,998,644.72	1.51
7	002035	华帝股份	49,999,976.54	1.37
8	000401	冀东水泥	46,273,297.50	1.27
9	600298	安琪酵母	36,048,872.79	0.99
10	002285	世联地产	35,787,897.39	0.98
11	600079	人福医药	28,340,899.38	0.78
12	600585	海螺水泥	26,830,934.25	0.74
13	002414	高德红外	21,885,744.10	0.60
14	002073	软控股份	21,586,715.19	0.59
15	600809	山西汾酒	20,726,028.33	0.57
16	600828	成商集团	20,613,569.80	0.57
17	002152	广电运通	16,615,205.15	0.46
18	600559	老白干酒	15,579,795.04	0.43
19	600778	友好集团	13,795,301.31	0.38
20	000063	中兴通讯	13,659,762.25	0.37

注:"买入金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

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	600050	中国联通	136,845,033.36	3.76
2	601601	中国太保	89,617,469.98	2.46
3	601318	中国平安	84,090,308.79	2.31
4	601607	上海医药	70,527,272.02	1.94
5	002038	双鹭药业	62,589,231.04	1.72
6	601117	中国化学	59,818,024.02	1.64
7	000012	南玻A	55,164,029.29	1.51
8	002111	威海广泰	49,246,012.71	1.35
9	000401	冀东水泥	41,701,040.50	1.14
10	600585	海螺水泥	40,227,900.28	1.10
11	000989	九芝堂	39,690,511.62	1.09
12	002051	中工国际	34,999,883.95	0.96
13	002465	海格通信	28,889,451.48	0.79
14	600690	青岛海尔	27,736,150.44	0.76
15	600521	华海药业	26,800,696.89	0.74
16	000712	锦龙股份	26,081,345.52	0.72
17	002024	苏宁电器	23,970,447.29	0.66
18	002035	华帝股份	23,499,434.18	0.64
19	002430	杭氧股份	19,940,535.49	0.55
20	002414	高德红外	19,546,366.78	0.54

注:"卖出金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

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