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

银华–道琼斯88精选证券投资基金

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 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–道琼斯 88 精选证券投资基金
基金简称	银华–道琼斯 88 指数
基金主代码	180003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年 8 月 11 日
基金管理人	银华基金管理有限公司
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	10,535,834,814.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将运用增强型指数化投资方法，通过严格的投资流程和数量化风险管理，在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金,以道琼斯中国 88 指数为基金投资组合跟踪的标的指数,股票指数化投资部分主要投资于标的指数的成份股票,增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票,在控制与标的指数偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益率。 本基金将不高于 75%的资产投资于股票，将不低于 20%的资产投资于国债。且保持不低于基金资产 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在法律环境允许后,本基金股票资产投资比例上限将调整为 95%。
业绩比较基准	道琼斯中国 88 指数
风险收益特征	1.与标的指数偏离的风险揭示:本基金采用的增强性投资策略将产生跟踪误差,基金的风险特征可能有别于指数本身。 2.基金价格变动风险提示:本基金因股票资产投资比例较大,当所追踪之标的指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金资产净值的相应下跌,产生跌破基金发行价的风险。 3.更换标的指数风险提示:本基金管理人在本招募说明书规定的特定情况下有权更换标的指数,由此可能产生风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	尹东
	联系电话	(010)58163000	(010)67595003
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yindongz.zh@ccb.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	(010)67595096
传真		(010)58163027	(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	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	-660,203,211.34
本期利润	-588,408,671.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0557
本期加权平均净值利润率	-6.06%
本期基金份额净值增长率	-6.12%
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	-1,551,695,601.16
期末可供分配基金份额利润	-0.1473
期末基金资产净值	9,247,686,877.02
期末基金份额净值	0.8777
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	268.25%

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。

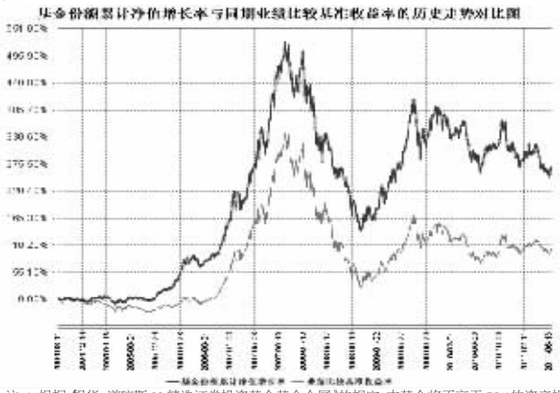
3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.06%	1.14%	0.65%	1.17%	-0.59%	-0.03%
过去三个月	-7.36%	1.25%	-3.97%	1.09%	-3.39%	0.16%
过去六个月	-6.12%	1.34%	0.29%	1.20%	-6.41%	0.14%
过去一年	0.35%	1.38%	15.64%	1.37%	-15.29%	0.01%
过去三年	4.04%	1.72%	-1.00%	2.00%	5.04%	-0.28%
自基金合同生效日起至今	268.25%	1.66%	102.69%	1.97%	165.56%	-0.31%

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:1、根据《银华–道琼斯 88 精选证券投资基金基金合同》的规定:本基金将不高于 75%的资产投资于股票,将不低于 20%的资产投资于国债,且保持不低于基金资产 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。鉴于现行法规已经没有对基金投资于债券的限制性规定,本基金股票资产投资比例上限调整为 95%。

2、本基金按合同规定在合同生效后 3 个月内已达到上述规定的投资比例。

§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		
陈秀峰先生	本基金的基金经理	2010年 9 月 8 日	-	9年	硕士学历。曾先后任职于中国民族国际信托投资公司、中国信息信托投资公司。2002 年 8 月加盟银华基金管理有限公司,历任基金经理助理、投资部总监助理、投资部执行总监、机构理财部负责人、企业年金与机构理财部总监、特定资产管理部总监。具有从业资格。国籍:中国。
俞世典先生	本基金的基金经理助理	2011年 4 月 7 日	-	8年	硕士学位。2003 年至 2007 年在上海博弘投资公司从事金融工程研究分析工作，曾任投资研究部经理和公司副总经理职务。2008 年 3 月加盟银华基金管理有限公司。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–道琼斯 88 精选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 年上半年度,CPI 指数维持上涨态势,央行采取了上调准备金率和上调存贷款利率等紧缩政策。上半年主要的市场指数都出现一定幅度的振荡调整态势，尤其是创业板和中小板指数调整幅度相对较大。整个上半年度,行业与个股分化严重,一些传统低估值行业调整幅度较小,尤其是水泥和食品饮料行业还走出了振荡上涨走势;而代表新经济和未来产业发展方向的高估值行业,由于估值太高和业绩低于预期的作用,下跌幅度比较大。根据政府的政策导向,本基金根据市场状况,本着谨慎的态度,股票仓位主要集中到金融、煤炭、有色和石油化工等低估值蓝筹行业,同时在这些行业之间作出了适当的调整。

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 0.8777 元,本报告期份额净值增长率为-6.12%，同期业绩比较基准增长率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年下半年国家将继续实行积极的财政政策,同时采用稳健的货币政策。房地产调控在 2011 年下半年还看不到放松的迹象,经济将在保增长的基础上继续进行结构调整。2011 年下半年度经济运行仍然保持向好趋势,在积极财政政策导向下,固定资产投资将稳步增长,GDP 同比增速稳步下行环比见底可能性增大,CPI 将逐渐见顶回落,出口增速继续保持稳定,国内消费有望继续平稳增长。一方面,随着 CPI 的见顶回落,货币政策未来大幅紧缩的预期基本消除,下半年市场的货币流动性将得到明显的改善,股票市场将在流动性改善情况下迎来一波中期上涨行情;另一方面,由于房地产调控对地产、银行等股票的影响已经过度反映在了股票的市盈率中,这些行业具有估值向上提升的机会。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

§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,本基金未实施利润分配。

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:银华–道琼斯 88 精选证券投资基金

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	305,361,755.48	1,001,877,976.79
结算备付金	4,401,611.95	11,188,648.62
存出保证金	5,097,050.90	3,088,685.74
交易性金融资产	9,060,458,045.15	8,648,480,966.38
其中:股票投资	8,618,873,045.15	8,102,725,966.38
基金投资	-	-
债券投资	441,585,000.00	545,755,000.00
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	-	270,319,446.08
应收利息	4,493,345.02	13,850,794.45
应收股利	24,822,547.40	-
应收申购款	3,005,847.75	35,472,452.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,407,640,203.65	9,984,278,970.67
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	137,455,885.72	-
应付赎回款	3,989,304.27	5,294,989.89
应付管理人报酬	8,926,422.72	10,522,768.98
应付托管费	1,859,671.40	2,192,243.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,267,924.53	7,953,210.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,454,117.99	1,360,078.64
负债合计	159,953,326.63	27,323,291.67
所有者权益:		
实收基金	10,535,834,814.26	10,650,228,872.97
未分配利润	-1,288,147,937.24	-693,273,193.97
所有者权益合计	9,247,686,877.02	9,956,955,679.00
负债和所有者权益总计	9,407,640,203.65	9,984,278,970.67

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值为人民币 0.8777 元,基金份额总额为 10,535,834,814.26 份。

6.2 利润表

会计主体:银华–道琼斯 88 精选证券投资基金

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	-491,926,619.59	-2,947,782,124.07
1.利息收入	6,880,108.64	7,137,917.67
其中:存款利息收入	1,686,316.83	4,326,291.00
债券利息收入	5,193,791.81	2,811,626.67
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)	-571,007,064.04	-254,933,757.69
其中:股票投资收益	-686,122,538.35	-302,951,958.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,282,571.43	-10,400.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	117,398,045.74	48,028,601.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	71,794,540.12	-2,701,340,252.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	405,795.69	1,353,968.65
减:二、费用	96,482,051.63	118,772,901.34
1.管理人报酬	57,848,548.44	71,627,087.54
2.托管费	12,051,780.96	14,922,309.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	26,358,904.28	31,992,208.34
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	222,817.95	231,295.59
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-588,408,671.22	-3,066,555,025.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-588,408,671.22	-3,066,555,025.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华–道琼斯 88 精选证券投资基金

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)	10,650,228,872.97	-693,273,193.97	9,956,955,679.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-588,408,671.22	-588,408,671.22
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)	-114,394,058.71	-6,466,072.05	-120,860,130.76
其中:1.基金申购款	770,439,899.34	-54,017,835.48	716,422,063.86
2.基金赎回款	-884,833,958.05	47,551,763.43	-837,282,194.62
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)	10,535,834,814.26	-1,288,147,937.24	9,247,686,877.02
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)	12,071,458,576.92	1,692,442,909.26	13,763,901,486.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,066,555,025.41	-3,066,555,025.41
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)	-412,120,377.47	-88,532,098.16	-500,652,475.63
其中:1.基金申购款	1,145,954,192.95	-4,853,825.47	1,141,100,367.48
2.基金赎回款	-1,558,074,570.42	-83,678,272.69	-1,641,752,843.11
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)	11,659,338,199.45	-1,462,644,214.31	10,196,693,985.14

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和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

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

本基金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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
东北证券	681,394,022.29	3.87%	1,128,488,465.40	5.41%
西南证券	480,755,879.94	2.73%	704,827,609.47	3.38%
第一创业	435,376,595.23	2.48%	2,426,054,841.76	11.63%

6.4.4.1.2 债券交易

注: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。

6.4.4.1.3 债券回购交易

注: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回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

注: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。

6.4.4.1.5 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
东北证券	573,548.46	3.88%	-	-
西南证券	408,640.45	2.77%	-	-
第一创业	370,071.46	2.51%	-	-
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
东北证券	935,266.56	5.36%	288,125.07	5.66%
西南证券	599,101.40	3.43%	-	-
第一创业	2,062,142.76	11.81%	623,577.89	12.26%

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	57,848,548.44	71,627,087.54
其中:支付销售机构的客户维护费	7,678,501.65	9,659,645.72

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%/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,由基金托管人于次月前五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	12,051,780.96	14,922,309.87

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五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

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
中国建设银行	305,361,755.48	1,560,201.40	805,042,492.51	4,130,427.92

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:本基金未因认购新发/增发而于期末持有流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:本基金本报告期末未持有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	8,618,873,045.15	91.62
	其中:股票	8,618,873,045.15	91.62
2	固定收益投资	441,585,000.00	4.69
	其中:债券	441,585,000.00	4.69
	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	309,763,367.43	3.29
6	其他各项资产	37,418,791.07	0.40
7	合计	9,407,640,203.65	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	2,576,569,272.60	27.86
C	制造业	1,017,879,394.36	11.01
C0	食品、饮料	2,934,700.00	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	98,700.00	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	833,230.00	0.01
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	656,770,232.32	7.10
C7	机械、设备、仪表	356,872,812.04	3.86
C8	医药、生物制品	369,720.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	101,700.00	0.00
E	建筑业	228,653,720.93	2.47
F	交通运输、仓储业	228,161,802.90	2.47
G	信息技术业	617,244,160.50	6.67
H	批发和零售贸易	684,100.00	0.01
I	金融、保险业	3,502,409,083.61	37.87
J	房地产业	648,170.00	0.01
K	社会服务业	142,380.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	276,300.00	0.00
	合计	8,172,770,084.90	88.38

7.2.2 积极投资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	232,272,376.20	2.51
C	制造业	63,418,536.80	0.69
C0	食品、饮料	63,297,636.80	0.68
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	120,900.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	76,050.00	0.00
E	建筑业	86,900.00	0.00
F	交通运输、仓储业	34,096,733.60	0.37
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	950,750.65	0.01
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	115,201,613.00	1.25
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	446,102,960.25	4.82

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	601088	中国神华	27,101,864	816,850,180.96	8.83
2	600036	招商银行	54,344,432	707,564,504.64	7.65
3	600030	中信证券	49,009,855	641,048,903.40	6.93
4	601318	中国平安	13,000,000	627,510,000.00	6.79
5	600016	民生银行	108,334,487	620,756,610.51	6.71
6	600050	中国联通	117,476,602	616,752,160.50	6.67
7	601699	潞安环能	16,619,630	545,290,060.30	5.90
8	601398	工商银行	105,069,651	468,610,643.46	5.07
9	600028	中国石化	55,325,112	455,325,671.76	4.92
10	000630	铜陵有色	16,128,008	388,684,992.80	4.20

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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。

7.3.2 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	600188	兖州煤业	6,579,954	232,272,376.20	2.51
2	000598	兴蓉投资	6,364,730	115,201,613.00	1.25
3	600543	莫高股份	5,999,776	63,297,636.80	0.68
4	002023	海特高新	1,999,910	33,918,473.60	0.37
5	002500	山西证券	61,011	558,250.65	0.01

注:投资者欲了解本报告期末基金积极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	601088	中国神华	672,874,902.69	6.76
2	600016	民生银行	640,701,243.80	6.43
3	000630	铜陵有色	531,104,574.61	5.33
4	600362	江西铜业	530,004,331.69	5.32
5	000983	西山煤电	506,100,765.18	5.08
6	601699	潞安环能	491,866,655.81	4.94
7	601398	工商银行	467,968,534.63	4.70
8	600028	中国石化	447,441,757.05	4.49
9	600089	特变电工	436,378,968.61	4.38
10	000060	中金岭南	259,037,687.68	2.60