银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30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
送出日期：2011年8月26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	银华沪深300指数证券投资基金（LOF）
基金简称	银华沪深300指数（LOF）
基金主代码	161811
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2009年10月14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	564,953,778.18份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009-10-30

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，追求跟踪误差最小化，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在沪深300指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪沪深300指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 如未来法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于股票指数期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，以使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后公告。 本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		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	yindong.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	1,932,193.64
本期利润	-12,876,203.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0239
本期加权平均净值利润率	-2.52%
本期基金份额净值增长率	-2.52%
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	-40,594,526.51
期末可供分配基金份额利润	-0.0719
期末基金资产净值	524,359,251.67
期末基金份额净值	0.928
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	-7.20%

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：开放式基金认购、申购、赎回费，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

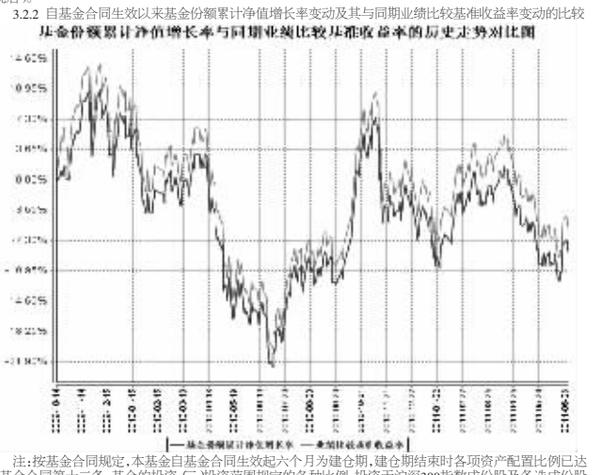
3.2 基金净值表现

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	1.98%	1.14%	1.35%	1.13%	0.63%	0.01%
过去三个月	-4.72%	1.04%	-5.27%	1.04%	0.55%	0.00%
过去六个月	-2.52%	1.16%	-2.51%	1.17%	-0.01%	-0.01%
过去一年	17.62%	1.33%	17.91%	1.33%	-0.29%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-7.20%	1.39%	-4.34%	1.43%	-2.86%	-0.04%

注：由于本基金的投资标的为沪深300指数，且本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

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为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同第十二条：基金的投资（三）投资范围规定的各种比例，投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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		
周毅先生	本基金的基金经理，公司境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监。	2010年6月21日	-	12年	硕士学位。毕业于北京大学，南卡罗莱纳大学，约翰霍普金斯大学。历任美国普华永道金融服务部经理，巴克莱银行量化分析部副总裁，巴克莱亚太有限公司副董事。2009年9月加盟银华基金管理有限公司，自2010年5月7日起担任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2010年8月5日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2010年12月6日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。具有从业资格。国籍：美国。

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、《银华沪深300指数证券投资基金（LOF）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

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

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0.928元，本报告期份额净值增长率为-2.52%，同期业绩比较基准增长率为-2.51%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内，年化跟踪误差控制在4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在对通胀、增长、政策、资金等多种乐观预期的引领下，配合关于保障房的积极财政政策实施。整体来看，当前我国经济增速虽有回调，但幅度仍然缓和，在物价水平持续高企的背景下，上半年政策紧缩的调控节奏相当密集，同时需求结构和产业结构调整的进展依然缓慢。

对于下半年，我们认为相比6月中下旬，农产品价格涨幅可能会明显收窄。其中猪肉价格涨幅回归常态的可能性较高，但由于前期猪肉价格涨幅较大，CPI在近期内将处于较高的水平，近期涨幅较高的水产品预计后期涨幅也会回落。

我们认为7月PMI将会好于预期。但从绝对水平看，延续了3月以来偏弱的态势，需求即使有所恢复，但也相对平淡。我们认为政策已进入观察期，规范化票据操作、以及高铁事故可能引发的财政投资放缓等，都引发了"暗紧"格局。预期后期流动性将维持偏紧格局，各层面利率处于高位。

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：银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

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	28,611,656.13	25,898,717.56
结算备付金	70,256.07	396,802.16
存出保证金	125,277.82	21,147.24
交易性金融资产	495,315,687.52	443,184,220.68
其中：股票投资	495,315,687.52	443,184,220.68
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	-	2,456,442.10
应收利息	5,439.81	7,661.92
应收股利	674,604.72	-
应收申购款	336,806.27	732,727.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	525,139,728.34	472,697,719.11
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	-	-
应付赎回款	209,784.75	32,580.39
应付管理人报酬	209,795.17	218,813.84
应付托管费	62,938.56	65,644.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	94,081.72	332,051.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	203,876.47	50,092.16
负债合计	780,476.67	699,181.97
所有者权益：		
实收基金	564,953,778.18	495,740,616.48
未分配利润	-40,594,526.51	-23,742,079.34
所有者权益合计	524,359,251.67	471,998,537.14
负债和所有者权益总计	525,139,728.34	472,697,719.11

注：报告截止日2011年06月30日，基金份额净值0.928元，基金份额总额564,953,778.18份。

6.2 利润表

会计主体：银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

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	-10,274,843.07	-168,906,828.11
1.利息收入	112,999.64	154,870.38
其中：存款利息收入	112,999.64	154,870.38
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）	4,300,101.39	667,521.94
其中：股票投资收益	-221,544.35	-2,892,999.72
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	4,521,645.74	3,560,521.66
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-14,808,396.94	-170,137,161.58
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	120,452.84	407,941.15
二、费用	2,601,360.23	2,625,052.63
1.管理人报酬	1,266,167.60	1,413,352.56
2.托管费	379,850.32	424,005.75
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	740,548.20	548,496.65
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	214,794.11	239,197.67
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-12,876,203.30	-171,531,880.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-12,876,203.30	-171,531,880.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

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）	495,740,616.48	-23,742,079.34	471,998,537.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,876,203.30	-12,876,203.30
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）	69,213,161.70	-3,976,243.87	65,236,917.83
其中：1.基金申购款	200,718,484.83	-6,679,063.50	194,039,421.33
2.基金赎回款	-131,505,323.13	2,702,819.63	-128,802,503.50
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）	564,953,778.18	-40,594,526.51	524,359,251.67

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）	580,639,981.57	46,672,379.83	627,312,361.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-171,531,880.74	-171,531,880.74
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）	48,398,709.61	-7,647,859.54	40,750,850.07
其中：1.基金申购款	378,019,125.08	-10,920,298.59	367,098,826.49
2.基金赎回款	-329,620,415.47	3,272,439.05	-326,347,976.42
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）	629,038,691.18	-132,507,360.45	496,531,330.73

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

本基金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。

6.4.2 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无发生变化的情况。

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
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
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

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
第一创业	1,643,483.25	0.33%	-	-

6.4.4.1.2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。

6.4.4.1.3 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	1,397.11	0.33%	1,397.11	1.48%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	1,266,167.60	1,413,352.56
其中：支付销售机构的客户维护费	311,977.70	371,280.81

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%/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，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	379,850.32	424,005.75

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/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

本基金本报告期末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

本基金的基金管理人于本报告期末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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金份额。

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	28,611,656.13	107,491.97	30,432,608.25	144,027.90

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600216	浙江医药	2011年6月27日	非公开发行股票	31.39	2011年7月4日	32.60	24,743	865,684.48	776,682.77	-
000876	新希望	2011年6月29日	重大资产重组	19.95	2011年7月5日	21.95	38,153	678,374.97	761,152.35	-
000652	泰达股份	2010年11月22日	筹划重大事项	7.68	2011年7月8日	7.68	94,815	764,551.57	728,179.20	-
600170	上海建工	2011年6月29日	重大资产重组	15.59	2011年7月4日	16.25	38,044	610,684.49	593,105.96	-
000959	首钢股份	2010年10月29日	重大资产重组	4.42	未知	未知	119,296	574,833.57	527,288.32	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本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	495,315,687.52	94.32
	其中：股票	495,315,687.52	94.32
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	28,681,912.20	5.46
6	其他各项资产	1,142,128.62	0.22
7	合计	525,139,728.34	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	1,650,728.65	0.31
B	采掘业	58,738,837.32	11.20
C	制造业	178,018,646.56	33.95
C0	食品、饮料	29,262,317.76	5.58
C1	纺织、服装、皮毛	1,746,955.98	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,739,120.05	2.24
C5	电子	4,252,061.63	0.81
C6	金属、非金属	45,963,192.74	8.77
C7	机械、设备、仪表	63,988,567.69	12.20
C8	医药、生物制品	19,847,941.11	3.79
C99	其他制造业	1,218,489.60	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,313,948.96	2.16
E	建筑业	15,328,018.98	2.92
F	交通运输、仓储业	19,218,303.57	3.67
G	信息技术业	15,980,720.42	3.05
H	批发和零售贸易	13,902,797.73	2.65
I	金融、保险业	134,125,750.50	25.58
J	房地产业	25,527,247.90	4.87
K	社会服务业	4,476,597.36	0.85
L	传播与文化产业	580,483.54	0.11
M	综合类	10,392,107.03	1.98
	合计	489,254,188.52	93.31

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	649,798.00	0.12
B	采掘业	234,088.00	0.04
C	制造业	3,191,919.00	0.61
C0	食品、饮料	454,480.00	0.09
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	299,633.00	0.06
C5	电子	619,592.00	0.12
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,388,804.00	0.26
C8	医药、生物制品	429,410.00	0.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	234,000.00	0.04
F	交通运输、仓储业	358,720.00	0.07
G	信息技术业	95,404.00	0.02
H	批发和零售贸易	315,213.00	0.06
I	金融、保险业	524,689.00	0.10
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	224,908.00	0.04
M	综合类	232,760.00	0.04
	合计	6,061,499.00	1.16

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	601318	中国平安	300,528	14,506,486.56	2.77
2	600036	招商银行	1,109,430	14,444,778.60	2.75
3	600016	民生银行	2,026,306	11,610,733.38	2.21
4	601398	工商银行	2,344,189	10,455,082.94	1.99
5	601328	交通银行	1,867,301	10,344,847.54	1.97
6	600000	浦发银行	1,004,011	9,879,468.24	1.88
7	601166	兴业银行	677,416	9,131,567.68	1.74
8	601088	中国神华	295,870	8,917,521.80	1.70
9	600030	中信证券	624,544	8,169,035.52	1.56
10	000002	万 科A	868,527	7,339,053.15	1.40

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	002073	软控股份	32,500	669,500.00	0.13
2	002106	莱宝高科	15,800	477,950.00	0.09
3	000869	张 裕A	4,600	454,480.00	0.09
4	600267	海正药业	11,500	429,410.00	0.08
5	601118	海南橡胶	34,400	423,808.00	0.08

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	601318	中国平安	5,147,892.08	1.09
2	600036	招商银行	4,768,270.43	1.01
3	600000	浦发银行	4,442,783.37	0.94
4	600016	民生银行	3,574,718.00	0.76
5	600887	伊利股份	3,518,917.27	0.75
6	601398	工商银行	3,513,098.08	0.74
7	601328	DR交通银	3,463,219.17	0.73
8	601166	兴业银行	3,460,057.12	0.73
9	600837	海通证券	3,087,177.01	0.65
10	601088	中国神华	3,055,150.89	0.65
11	000776	广发证券	2,765,039.94	0.59
12	600406	国电南瑞	2,708,894.50	0.57
13	000002	万 科A	2,668,750.00	0.57
14	600030	中信证券	2,591,851.00	0.55
15	600585	海螺水泥	2,477,901.43	0.52
16	600276	恒瑞医药	2,450,484.38	0.52
17	600132	重庆啤酒	2,201,219.99	0.47
18	601106	中国一重	2,185,726.01	0.46
19	600519	贵州茅台	2,096,236.28	0.44
20	601601	中国太保	2,030,531.62	0.43

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	601318	中国平安	4,251,251.69	0.90
2	600036	招商银行	3,745,914.94	0.79
3	600016	民生银行	2,947,918.70	0.62
4	601328	DR交通银	2,781,448.89	0.59
5	601166	兴业银行	2,770,492.37	0.59
6	601398	工商银行	2,724,775.83	0.58
7	601088	中国神华	2,477,738.17	0.52
8	600000	浦发银行	2,268