国泰沪深300指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十九日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月25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2011年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰沪深300指数
基金主代码	020011
交易代码	020011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年11月11日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
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	10,104,676,764.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法,通过严格的投资约束和数量化风险控制手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%,实现对沪深300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为以完全复制为目标的指数基金,按照成份股在沪深300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

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		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	唐州徽
	联系电话	021-38561600转	010-66594855
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgcxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		(021)38569000,400-888-8688	95566
传真		021-38561800	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.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼

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	-55,568,455.47
本期利润	-83,033,683.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0076
本期基金份额净值增长率	-2.07%
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	-0.0840
期末基金资产净值	6,210,321,925.58
期末基金份额净值	0.615

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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

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

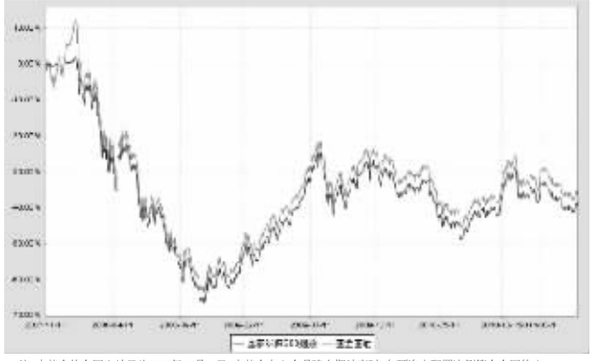
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.99%	1.10%	1.29%	1.07%	0.70%	0.03%
过去三个月	-4.50%	1.02%	-4.97%	0.99%	0.47%	0.03%
过去六个月	-2.07%	1.15%	-2.31%	1.11%	0.24%	0.04%
过去一年	18.27%	1.32%	17.08%	1.26%	1.19%	0.06%
过去三年	9.04%	1.90%	9.81%	1.81%	-0.77%	0.09%
自基金成立起至今	-38.43%	2.00%	-35.05%	1.98%	-3.38%	0.02%

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

国泰沪深300指数证券投资基金

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

(2007年11月11日至2011年6月30日)



注:本基金的合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日,是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币,公司注册地为上海,并在北京和深圳设有分公司。

截至2011年6月30日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式),以及17只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金。另外,本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,成为目前业内少数拥有"全牌照"的基金公司之一,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

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		
章腰	本基金的基金经理、国泰金融ETF基金的基金经理、国泰金融ETF联接基金的基金经理	2011-05-09	-	5	博士。曾任职于平安资产管理公司。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司,任数量金融分析师,2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理;2011年3月起担任国泰金融ETF及国泰金融ETF联接基金的基金经理;2011年5月起兼任国泰沪深300指数基金的基金经理。
刘翔	本基金的基金经理、国泰纳斯达克100指数(QDII)的基金经理	2009-03-12	2011-05-30	6	硕士研究生。曾就职于中国海信对外技术服务公司深圳分公司、Sprint AAA公司、美国通用电气公司、深圳中兴通讯股份有限公司,2005年8月至2007年7月在标准普尔信息服务公司任资深分析师,2007年7月至2007年12月在招商基金管理有限公司任高级信用分析师。2007年12月加盟国泰基金管理有限公司,任高级策略分析师,2009年3月至2011年5月任国泰沪深300指数的基金经理,2010年4月至2011年5月任国泰纳斯达克100指数(QDII)的基金经理。
徐皓	本基金的基金经理助理、国泰金融ETF基金的基金经理助理、国泰金融ETF联接基金的基金经理助理	2011-06-03	-	4	硕士,FRM,中级经济师。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010年5月加盟国泰基金,任高级风控经理。2011年6月起担任国泰金融ETF、国泰金融ETF联接基金及国泰沪深300指数基金的基金经理助理。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定,严格遵守基金合同和招募说明书约定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为,投资运作符合法律法规和基金合同的规定,未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待,基金管理小组保持独立运作,并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系,有效保障投资人的合法权益。

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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制,确保公平对待所管理的所有基金和投资组合,切实防范利益输送行为。

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

本基金是被动跟踪指数的基金,无同类基金可供比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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

在截止2011年06月30日的本报告期内,基金单位净值从0.628元下跌到0.615元,区间净值增长率为-2.07%;同期沪深300 000300)指数从3128.26下跌到3044.09,涨跌幅为-2.69%,以相应90%仓位的业绩基准来看,本基金获得了一定的超额收益,体现了日常投资管理的有效性。

2011年上半年前半阶段,沪深300指数触底反弹冲高到3380.53点,随后由于物价水平的持续上涨、PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之希腊债务危机、日本核泄漏危机的升级、国际版加快推进等利空消息,沪深300指数进入了下行区间,并在6月20日下跌到了2011年上半年度最低点2862.41点,随后由于政府对物价控制信心的表态、国内通胀预期的修正以及希腊危机的缓和,6月下旬走出了一波上涨行情,报收于6月30日的3044.09点,沪深300指数的走势整体呈现了冲高回落的倒U型格局。

本报告期内,我们根据市场行情分析、判断以及日常申赎情况,对股票仓位及头寸进行了合理安排;在交易策略上,我们严格根据基金契约全面跟踪沪深300指数,避免不必要的主动操作,减少了交易冲击成本。报告期内,本基金组合状况跟踪效果如下:

①)跟踪偏差TD平均为0.00178%,范围在-0.1482%至0.1493%之间;

②)截至报告日,日均跟踪误差TE稳定在0.0727%。

跟踪误差TE低于基金合同规定的0.35%。TD和TE变化相对稳定,表明本基金所采用的跟踪技术稳定可靠。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金2011年上半年净值增长率为-2.07%,同期业绩比较基准收益率为-2.31%。

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2011年上半年,经过了近四个月的上涨后,通胀压力、经济增速放缓、紧缩的货币政策以及复杂多变的国际政治、经济环境,造成了市场的振荡回调。我们预期,2011年下半年的经济和政策环境比2011上半年将有相对改善,较低的估值、物价的回落、投资拉动、投资者信心的恢复以及相对灵活的货币政策带来的流动性释放将为A股市场提供了较为安全的边际和上升空间。

通胀压力以及政府抑制通胀一系列措施仍将是下半年影响市场及投资者预期的最主要因素,全年的物价水平呈现高开低走的轨迹仍然是大概率事件,随着去库存化、主要农产品价格的逐步回落以及上半年紧缩性货币政策的持续效用,预计第三季度末CPI将见顶回落。目前的通胀预期仍在政府调控的有效控制范围内,一旦CPI见顶回落,后续调控频度将有所下降,政府对重点领域和薄弱环节的信贷支持特别是对"三农"、中小企业的信贷支持的实施,也将使目前市场流动性紧张的情况有一定缓解。

保障房、水利等基础设施建设,将使投资维持在高位运行,确保中国经济增长速度不会出现实质性放缓;希腊危机出现转机以及发达经济体的复苏等外围环境的好转将在一定程度上缓解贸易顺差逐步缩窄的影响。个税改革以及一系列切实提高居民实际收入的保障措施,将使民生目标与经济增长产生协同效应,并通过居民消费能力和意愿的提高促进经济增长。

然而我国经济社会发展中短期与长期问题交织,投资与消费增长失衡,经济增速放缓与资产泡沫的扩大、过度投资与融资困难并存,结构性与体制性问题突出,调控工具的单一性与调控目标的多样化的不匹配给宏观调控增大了难度,也增加了经济运行及市场走势的不确定性。

不过,我们坚信沪深300这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间是不言而喻的。基于长期投资、价值投资的理念,投资者可积极利用沪深300指数基金这一优良的资产配置工具,把握中国经济长期增长机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责,成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干,均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末,根据本基金基金合同和相关法律法规的规定,本基金无应分配但尚未实施的利润。

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")在对国泰沪深300指数证券投资基金(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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(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)、投资组合报告等数据核对无误。

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:国泰沪深300指数证券投资基金

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	329,823,811.51	226,047,974.36
结算备付金	532,819.96	2,776,274.25
存出保证金	975,843.15	757,043.00
交易性金融资产	5,901,246,794.57	7,389,689,809.53
其中:股票投资	5,871,300,794.57	7,162,441,809.53
基金投资	-	-
债券投资	29,946,000.00	227,248,000.00
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	-	8,015,070.74
应收利息	624,539.80	2,440,053.97
应收股利	8,003,285.66	-
应收申购款	1,655,882.18	2,569,369.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,242,862,976.83	7,632,295,595.25
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	12,366,123.62	-
应付赎回款	14,061,045.13	3,865,734.81
应付管理人报酬	2,451,088.93	3,292,214.60
应付托管费	490,217.79	658,442.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,015,684.35	2,021,502.88
应交税费	652,003.80	652,003.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,504,887.63	1,387,742.19
负债合计	32,541,051.25	11,877,641.21
所有者权益:		
实收基金	7,059,022,110.09	8,479,859,022.19
未分配利润	-848,700,184.51	-859,441,068.15
所有者权益合计	6,210,321,925.58	7,620,417,954.04
负债和所有者权益总计	6,242,862,976.83	7,632,295,595.25

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.615元,基金份额总额10,104,676,764.49份。

6.2 利润表

会计主体:国泰沪深300指数证券投资基金

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	-56,739,266.13	-2,018,897,498.79
1.利息收入	2,094,539.73	3,687,199.16
其中:存款利息收入	1,261,089.52	1,011,077.11
债券利息收入	833,450.21	2,676,122.05
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)	-33,400,853.18	-42,338,597.17
其中:股票投资收益	-87,243,268.61	-76,784,256.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,135,259.02	-2,593,108.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	51,707,156.41	37,038,766.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-27,465,227.95	-1,981,559,478.27
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,032,275.27	1,313,377.49
减:二、费用	26,294,417.29	24,295,017.44
1.管理人报酬	17,149,922.84	16,878,480.60
2.托管费	3,429,984.63	3,375,696.13
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,787,731.41	3,118,304.26
5.利息支出	-	29,103.58
其中:卖出回购金融资产支出	-	29,103.58
6.其他费用	926,778.41	893,432.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-83,033,683.42	-2,043,192,516.23
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-83,033,683.42	-2,043,192,516.23

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰沪深300指数证券投资基金

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)	8,479,859,022.19	-859,441,068.15	7,620,417,954.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-83,033,683.42	-83,033,683.42
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)	-1,420,836,912.10	93,774,567.06	-1,327,062,345.04
其中:1.基金申购款	908,131,003.37	-104,822,167.88	803,308,835.49
2.基金赎回款	-2,328,967,915.47	198,596,734.94	-2,130,371,180.53
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)	7,059,022,110.09	-848,700,184.51	6,210,321,925.58
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
项目	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)	7,708,032,102.68	132,834,087.78	7,840,866,190.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,043,192,516.23	-2,043,192,516.23
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)	245,852,724.07	-120,336,821.80	125,515,902.27
其中:1.基金申购款	1,551,890,073.81	-212,167,728.97	1,339,722,344.84
2.基金赎回款	-1,306,037,349.74	91,830,907.17	-1,214,206,442.57
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)	7,953,884,826.75	-2,030,695,250.25	5,923,189,576.50

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:金旭,主管会计工作负责人:巴立康,会计机构负责人:王骏

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

无。

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

本报告期和本基金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
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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
中国建银投资有限责任公司("中国建投")	基金管理人的控股股东
中国国际金融有限公司("中金公司")	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
中国电力财务有限公司("中电财务")	基金管理人的股东

注:下述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

无。

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	17,149,922.84	16,878,480.60
其中:支付销售机构的客户维护费	1,508,966.23	3,492,629.85

注:支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.5%/当年天数。

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	3,429,984.63	3,375,696.13

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1%/当年天数。

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

无。

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

无。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中电财务	-	-	70,520,451.34	0.58%
中国银行高邮支行	-	-	2,684,027.11	0.02%

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	329,823,811.51	1,244,556.15	166,253,460.22	980,729.68

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 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
中金公司	600428	中远航运	配股	279.806	1,555,721.36
中金公司	110015	石化转债	新债老股东配售	174,300	17,430,000.00
中金公司	110015	石化转债	新债网下发行	47,320	4,732,000.00
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
中金公司	600036	招商银行	配股	1,822,451	16,128,691.35
中金公司	601328	交通银行	配股	3,537,546	15,918,957.00

6.4.4.7其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

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
600369	西南证券	2011-03-01	公布重大事项停牌	11.87	2011-08-16	12.49	582,051	9,663,473.26	6,908,945.37	-
000959	首钢股份	2010-10-29	公布重大事项停牌	4.42	-	-	1,849,307	9,974,716.64	8,173,936.94	-
600170	上海建工	2011-06-29	公布重大事项停牌	15.59	2011-07-04	16.25	457,945	6,181,052.00	7,139,362.55	-
000652	泰达股份	2010-11-22	公布重大事项停牌	7.68	2011-07-08	7.68	1,394,867	13,812,455.93	10,712,578.56	-
000876	新希望	2011-06-29	公布重大事项停牌	19.95	2011-07-05	21.95	439,316	5,664,636.07	8,764,354.20	-
600216	浙江医药	2011-06-27	公布重大事项停牌	31.39	2011-07-04	32.60	286,825	8,406,583.72	9,003,436.75	-

注:本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

①)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2011年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为5,881,292,794.57元,属于第二层级的余额为19,954,000.00元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级7,071,618,193.07元,第二层级318,071,616.46元,无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值转入的层级。

对于采用指数收益法进行估值调整的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010年度:同)。

于本会计期间内,本基金持有的河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票("双汇发展")因重大事项停牌。由于该重大事项对于双汇发展估值的影响程度更多取决于不可观察的输入值,本基金于停牌期间将双汇发展从第一层级转入第三层级,并于复牌后打开跌停之日起将其从第三层级转回第一层级。在上述层级转换中,从第一层级转入第三层级时涉及的公允价值为26,156,690.20元,从第三层级转回第一层时涉及的公允价值为23,451,612.30元,在估值属于第三层级期间计入损益的公允价值变动损失为2,705,077.90元。

②)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	5,871,300,794.57	94.05
	其中:股票	5,871,300,794.57	94.05
2	固定收益投资	29,946,000.00	0.48
	其中:债券	29,946,000.00	0.48
	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	330,356,631.47	5.29
6	其他各项资产	11,259,550.79	0.18
7	合计	6,242,862,976.83	100.00

7.1 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	19,823,249.73	0.32
B	采掘业	709,728,405.90	11.43
C	制造业	2,123,316,802.71	34.19
C0	食品、饮料	347,126,987.46	5.59
C1	纺织、服装、皮毛	20,675,481.12	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	144,477,285.48	2.33
C5	电子	48,736,658.12	0.78
C6	金属、非金属	541,492,902.60	8.72
C7	机械、设备、仪表	766,286,179.54	12.34
C8	医药、生物制品	235,945,655.28	3.80
C99	其他制造业	18,575,653.11	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	137,438,059.35	2.21
E	建筑业	179,352,910.26	2.89
F	交通运输、仓储业	247,236,845.37	3.98
G	信息技术业	189,893,959.43	3.06
H	批发和零售贸易	168,128,963.24	2.71
I	金融、保险业	1,582,091,705.01	25.48
J	房地产业	325,025,486.56	5.23
K	社会服务业	55,408,038.23	0.89
L	传播与文化产业	7,094,308.57	0.11
M	综合类	126,762,060.21	2.04
	合计	5,871,300,794.57	94.54

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2 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

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	600036	招商银行	14,462,714	188,304,536.28	3.03
2	601318	中国平安	3,631,804	175,307,179.08	2.82
3	600016	民生银行	24,632,350	141,143,365.50	2.27
4	601328	交通银行	23,214,644	128,609,127.76	2.07
5	600000	浦发银行	12,649,656	124,472,615.04	2.00
6	601166	兴业银行	8,681,789	117,030,515.72	1.88
7	601088	中国神华	3,543,659	106,805,882.26	1.72
8	600030	中信证券	7,660,408	100,198,136.64	1.61
9	000002	万 科A	10,747,880	90,819,586.00	1.46
10	600519	贵州茅台	406,833	86,504,900.79	1.39

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人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