银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009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:中国工商银行股份有限公司
送出日期: 二零零九年八月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 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根据本基金合同规定, 于2009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2009年04月27日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华和谐主题混合
交易代码	180018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年04月27日
报告期末基金份额总额	2,708,947,010.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险的前提下获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	国家的政策导向将推动特定行业的增长,改善其经济效益;这些行业中的龙头企业受益更为明显,投资于这些企业将能取得较好的回报。因此,本基金将采取积极、主动的资产配置策略,注重风险与收益的平衡,重点投资受益于"构建和谐社会"政策相关行业的股票和具有较高投资价值的固定收益类资产,力求实现基金财产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	蒋松云
	联系电话	(010)58163000	(010)66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		(010)85186558 4006783333	95588
传真		(010)58163027	(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	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、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	2009年04月27日(基金合同生效日)至2009年06月30日
本期已实现收益	33,931,169.69
本期利润	224,515,085.09
加权平均基金份额本期利润	0.0837
本期加权平均净值利润率	8.09%
本期基金份额净值增长率	8.40%
3.1.2 期末数据和指标	2009年04月27日(基金合同生效日)至2009年06月30日
期末可供分配利润	34,229,063.42
期末可供分配基金份额利润	0.0126
期末基金资产净值	2,935,204,692.20
期末基金份额净值	1.084
3.1.3 累计期末指标	2009年04月27日(基金合同生效日)至2009年06月30日
基金份额累计净值增长率	8.40%

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。

4、本基金合同生效日为2009年4月27日,2009年度主要财务指标的计算期间为2009年4月27日至2009年6月30日。

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	6.38%	0.49%	7.76%	0.68%	-1.38%	-0.19%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.40%	0.48%	12.43%	0.78%	-4.03%	-0.30%

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:本基金生效日期为2009年4月27日,自基金合同生效日起到本报告期末不满一年。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,建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§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

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。

截止到2009年06月30日,本基金管理人管理着一只封闭式证券投资基金--天华证券投资基金和十一只开放式证券投资基金(含一只QDII基金)——银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆文俊先生	本基金的基金经理、投资管理部副总监。	2009年4月27日	—	8年	学士学位。曾任君安证券有限责任公司人力资源部行政主管、松岗营业部交易部经理、上海华创投资管理事务所合伙人、富国基金管理有限公司交易员、东吴证券有限责任公司投资经理、资产管理部副总经理、长信基金管理有限责任公司研究员等职。自2006年7月6日至2008年6月10日担任长信金利趋势股票型证券投资基金基金经理。2008年6月加盟银华基金管理有限公司,自2008年10月21日起担任银华核心价值优选股票型证券投资基金基金经理。具有从业资格。
万志勇先生	本基金的基金经理。	2009年5月26日	—	9年	硕士学位。曾任职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,从事行业研究和投资管理工作。2007年2月加盟银华基金管理有限公司,自2008年10月21日起担任银华领先策略股票型证券投资基金基金经理。具有从业资格。

注:1、因工作需要,经银华基金管理有限公司研究决定增聘万志勇先生担任本基金基金经理,与现任基金经理陆文俊先生共同管理本基金。该事项于2009年6月1日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站公开披露。

2、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。

3、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、《银华和谐主题灵活配置混合型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

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

报告期内,市场呈现上涨格局,行情主要按照滞胀和复苏二条主线展开。主要原因在于:全球经济下滑趋势得以遏制,中国经济复苏趋势明显;全球货币供应量显著增加,资金配置向新兴市场国家倾斜;大多数行业景气度逐步提高,经营数据逐步改善;市场信心强化,已经有过度乐观的倾向。

报告期内,本基金处于建仓期,按照稳健操作的思路,重点配置景气提升、估值较低的行业,主要是地产、金融、机械、汽车、钢铁、医药、消费、科技等。

截至报告期末,本基金份额净值为1.084元,本报告期份额净值增长率为8.40%,同期业绩比较基准增长率为12.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们对市场持谨慎乐观态度。主要在于全球经济逐步好转的态势将得以持续,中国经济仍将进一步好转;全球宽松的货币政策不会在短期内转向,通货膨胀从预期到现实还有较长时间;行业和企业的景气度继续好转,这将有利于提升上市公司业绩;在市场政策转向之前,我们投资者的信心依旧,不排除出现过度乐观的可能。同时我们需要看到,经过前期大幅上涨之后,市场估值水平提高较快,需要较好的基本面配合。在此期间,股价波动会显著加大,股价的驱动因素将由估值驱动转化为业绩驱动,股票的结构分化会比较明显。

在下一阶段中,我们继续坚持稳健操作的思路,重点关注景气提升的行业和公司,采取精选个股的策略提升收益水平。在具体行业选择上,重点关注受益于内外需增长的制造业,受益于宽松货币政策的金融、地产、资源等行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,估值委员会通过定期会议与临时会议结合的方式,综合考虑基金估值流程各关联方意见,审议公司旗下基金估值政策、程序及方法的科学合理性,保证了基金估值的公允、合理。

4.6.1 参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 参与估值流程各方及人员的职责分工

运作保障部分管高管与运作保障部总监分别担任估值委员会主任与副主任,估值委员会其他成员包括监察稽核部副总监、投资管理部副总监、研究部金融工程分析师、运作保障部估值主管、投资管理部合规控制员组成。以上人员均为公司各核心部门直接领导及主要业务负责人,具备多年从业经验与扎实专业技能。涉及境外投资的估值业务由境外投资部相关人员参与。

估值委员会主任职责:负责召开估值委员会工作会议,就估值参与各方提交的估值问题组织讨论,进行决议并组织实施。

投资管理部、境外投资部职责:负责对不存在活跃市场投资品种的估值方法建立相关模型进行跟踪,并在该投资品种存在活跃市场后比较估值价格和市价,判断检测估值方法的公允性。负责对无法按照估值方法取得公允价值投资品种的估值方法、托管行提出异议的投资品种的公允价值确定方法提出建议并提交估值委员会审议。

运作保障部职责:负责将无法按照《基金估值制度》估值方法取得公允价值的投资品种、托管行提出估值异议的投资品种提交估值委员会召开临时会议进行决议,负责执行估值会议决议。

监察稽核部:负责对投资管理部提交的估值方法合规性进行评价和判断,对估值程序进行监督和检查。

4.6.1.2 参与估值流程各方人员的专业胜任能力和相关工作经历

姓名	职务	估值委员会职责	专业胜任能力	相关工作经历
陈建军	总经理助理	估值委员会主任	22年金融证券行业从业经历,8年基金行业从业经历;硕士学位,经济师	曾在中国农业银行内蒙古自治区分行从事工商信贷工作;曾任深圳经济特区证券公司沈阳管理总部副总经理、总经理;首创资产管理公司成都分公司总经理;银华基金管理有限公司北京办事处主任。目前任银华基金管理有限公司总经理助理。
龚飒	运作保障部总监	估值委员会副主任;运作保障部代表	11年证券行业从业经历,6年基金行业从业经历;硕士学位;注册会计师、高级会计师	曾在湘财证券有限责任公司从事财务管理、稽核工作;在泰达荷银基金管理有限公司、交银施罗德基金管理有限公司从事基金营运管理工作。目前任银华基金管理有限公司运作保障部总监。
张树峰	基金会计主管	运作保障部代表	12年证券行业从业经历,2年基金行业从业经历;经济学学士;会计师	曾在南京保利实业有限公司从事财务工作;曾任华泰证券有限责任公司财务经理;巨田证券有限责任公司财务经理;目前任银华基金管理有限公司运作保障部基金会计主管。
王莹倩	监察稽核部副总监	监察稽核部代表	16年证券行业从业经历,5年基金行业从业经历;硕士学位;英国标准协会ISO9001:2000内审员证书	曾在海南港澳国际信托有限公司从事投资研究工作;曾任国信证券有限责任公司研究员。目前任银华基金管理有限公司监察稽核部副总监。
陆文俊	投资管理部副总监、基金经理	投资管理部代表	11年证券行业从业经历,4年基金行业从业经历;学士学位	曾在君安证券任行政主管、交易部经理;曾为上海华创投资管理事务所合伙人;曾任富国基金管理有限责任公司交易员;东吴证券投资经理、部门副总经理;长信基金管理有限责任公司研究员、基金经理。目前任银华基金管理有限公司投资管理部副总监、基金经理。
俞世典	金融工程分析师	研究部代表	5年金融工程研究分析工作经历;数量经济学硕士学位	曾在上海博弘投资公司先后担任投资研究部经理和公司副总经理。目前任银华基金管理有限公司金融工程分析师。
卞玺云	投资管理风险合规控制员	投资管理部代表	4年审计工作经历,1年风险控制工作经历;学士学位,注册会计师	曾任毕马威会计师事务所助理经理,从事审计工作;目前任银华基金管理有限公司投资管理部风险合规控制员。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理代表参与估值委员会会议,并就具体的估值问题提出建议和意见,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。运作保障部保证估值委员会制定的估值政策、程序及方法得到严格有效执行。

4.6.3 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 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

根据相关法律法规和基金合同的要求,结合本基金的实际运作情况,报告期内本基金未进行利润分配。

本基金管理人已于2009年7月21日发布分红公告,向截止2009年7月20日止在本基金注册登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.80元,实际分配金额为人民币174,346,425.36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

2009年上半年,本基金托管人在对银华和谐主题灵活配置混合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

2009年上半年,银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的管理人——银华基金管理有限公司在银华和谐主题灵活配置混合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。

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

本托管人依法对银华基金管理有限公司编制和披露的银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金2009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:银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2009年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年6月30日
资 产:		
银行存款	6.4.7.1	1,659,102,499.60
结算备付金		26,364,669.54
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,180,649,345.35
其中:股票投资		1,180,649,345.35
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		71,825,962.62
应收利息	6.4.7.5	365,150.29
应收股利		116,451.43
应收申购款		2,896,916.03
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,941,320,994.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	3,495,595.20
应付托管费	6.4.10.2.2	582,599.19
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,720,237.87
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	317,870.40
负债合计		6,116,302.66
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	2,708,947,010.00
未分配利润	6.4.7.10	226,257,682.20
所有者权益合计		2,935,204,692.20
负债和所有者权益总计		2,941,320,994.86

注:本基金于本报告期内合同生效。本期财务报表的实际编制期间系2009年4月27日(基金合同生效日)至2009年6月30日止。于报告截止日2009年06月30日,基金份额净值1.084元,基金份额总额2,708,947,010.00份。

6.2 利润表

会计主体:银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2009年04月27日至2009年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2009年4月27日(基金合同生效日)至2009年6月30日
一、收入		235,750,704.72
1.利息收入		2,647,725.38
其中:存款利息收入	6.4.7.11	2,013,971.38
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		633,754.00
其他利息收入		-
2.投资收益		42,390,349.11
其中:股票投资收益	6.4.7.12	37,708,519.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	4,681,829.51
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	190,583,915.40
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.17	128,714.83
二、费用		11,235,619.63
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	7,296,610.28
2.托管费	6.4.10.2.2	1,216,101.72
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.4.7.18	2,653,155.01
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	6.4.7.19	69,752.62
三、利润总额		224,515,085.09
所得税费用		-
四、净利润		224,515,085.09

注:本基金于本报告期内合同生效。本期财务报表的实际编制期间系2009年4月27日(基金合同生效日)起至2009年6月30日止。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2009年04月27日至2009年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2009年4月27日至2009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)		2,672,979,485.72	-	2,672,979,485.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	224,515,085.09	224,515,085.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		35,967,524.28	1,742,597.11	37,710,121.39
其中:1.基金申购款		35,967,524.28	1,742,597.11	37,710,121.39
2.基金赎回款		-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	6.4.11	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		2,708,947,010.00	226,257,682.20	2,935,204,692.20

注:本基金于本报告期内合同生效。本期财务报表的实际编制期间系2009年4月27日(基金合同生效日)起至2009年6月30日止。

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.1.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

6.4.1.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债),并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项,以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债,应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等,以及不作为有效套期工具的衍生金融工具,相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债,相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债,采用实际利率法,按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日,冲减股票投资成本;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证,在确认日记录所获分配的权证数量,该类权证初始成本为零;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于确认日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1)股票投资

1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B. 首次公开发行的股票采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,应按中国证监会相关规定处理。

(2)债券投资

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

4) 在全国银行间债券市场交易的债券及交易所固定收益平台交易的债券等,采用估值技术确定公允价值;

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

(3)权证投资

1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

2) 未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

3) 因持有股票而享有的配股权证采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中的相关原则进行估值。

(5)其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

2) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在实际持有期间内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失):

卖出交易所上市债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

卖出银行间同业市场交易债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.1.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.1.11 基金的收益分配政策

(1)每份基金单位享有同等分配权;

(2)基金当年收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;

(3)如果基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(4)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的30%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(5)基金持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金;选择采取红利再投资形式的,分红现金按红利发放日的基金单位净值转成相应的基金单位;本基金分红的默认方式为现金分红;

(6)红利分配时所发生的银行转帐或其他注册登记费用由投资者自行承担,若基金管理人收取该项费用,具体提取标准和方法应予以公告;

(7)法律、法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他会计政策和会计估计。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项。

6.4.2.3 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

本报告期内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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

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

本基金本报告期未通过关联方单元进行交易。

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2009年4月27日至2009年6月30日
当期应支付的管理费	7,296,610.28
其中:当期已支付	3,801,015.08
期末未支付	3,495,595.20

注:(1)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五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)上述表格中"当期已支付"不包含当期已支付的上期应付管理费。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2009年4月27日至2009年6月30日
当期应支付的托管费	1,216,101.72
其中:当期已支付	633,502.53
期末未支付	582,599.19

注:(1)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。

(2)上述表格中"当期已支付"不包含当期已支付的上期应付托管费。

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权(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报告期内未持有本基金份额。

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2009年4月27日至2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,659,102,499.60	1,958,296.59

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5 期末(2009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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券。

§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	1,180,649,345.35	40.14
	其中:股票	1,180,649,345.35	40.14
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	1,685,467,169.14	57.30
6	其他资产	75,204,480.37	2.56
7	合计	2,941,320,994.86	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	195,151,023.60	6.65
C	制造业	431,508,930.70	14.70
C0	食品、饮料	9,909,135.30	0.34
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	23,662,285.92	0.81
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	47,280,000.00	1.61
C7	机械、设备、仪表	313,361,509.48	10.68
C8	医药、生物制品	37,296,000.00	1.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	97,747,073.90	3.33
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	34,761,039.07	1.18
H	批发和零售贸易	42,801,897.98	1.46
I	金融、保险业	209,795,380.10	7.15
J	房地产业	147,984,000.00	5.04
K	社会服务业	20,900,000.00	0.71
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,180,649,345.35	40.22

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	000425	徐工科技	4,898,978	161,568,294.44	5.50
2	000002	万 科A	8,800,000	112,200,000.00	3.82
3	600036	招商银行	4,000,000	89,640,000.00	3.05
4	600028	中国石化	8,000,000	85,280,000.00	2.91
5	601186	中国铁建	6,199,910	63,797,073.90	2.17
6	600547	山东黄金	928,636	55,811,023.60	1.90
7	600104	上海汽车	3,725,164	55,691,201.80	1.90
8	601899	紫金矿业	5,300,000	54,060,000.00	1.84
9	600837	海通证券	2,999,938	49,348,980.10	1.68
10	600005	武钢股份	6,000,000	47,280,000.00	1.61

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000425	徐工科技	157,940,161.66	5.38
2	600028	中国石化	83,406,833.56	2.84
3	600036	招商银行	82,963,859.13	2.83
4	000002	万 科A	74,517,261.17	2.54
5	600005	武钢股份	69,650,159.86	2.37
6	600030	中信证券	65,061,953.13	2.22
7	601186	中国铁建	59,836,025.20	2.04
8	601899	紫金矿业	51,499,091.28	1.75
9	600104	上海汽车	50,322,733.47	1.71
10	600547	山东黄金	40,500,430.52	1.38
11	600837	海通证券	38,959,507.24	1.33
12	600426	华鲁恒升	36,276,270.11	1.24
13	600048	保利地产	36,153,208.78	1.23
14	600000	浦发银行	34,312,686.04	1.17
15	601390	中国中铁	32,957,864.35	1.12
16	000528	柳 工	29,850,380.61	1.02
17	000651	格力电器	28,204,896.80	0.96
18	600216	浙江医药	27,870,472.81	0.95
19	600050	中国联通	26,936,663.12	0.92
20	600019	宝钢股份	26,354,035.40	0.90

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末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	71,909,939.86	2.45
2	600048	保利地产	29,543,849.20	1.01
3	600019	宝钢股份	28,730,197.57	0.98
4	600036	招商银行	26,244,308.36	0.89
5	600050	中国联通	26,035,427.41	0.89
6	601006	大秦铁路	24,405,624.03	0.83
7	000402	金 融 街	19,584,497.69	0.67
8	600000	浦发银行	19,575,061.36	0.67
9	600005	武钢股份	18,763,036.00	0.64
10	000425	徐工科技	15,587,245.07	0.53
11	600875	东方电气	13,671,395.97	0.47
12	600600	青岛啤酒	13,622,251.16	0.46
13	000059	辽通化工	13,347,771.50	0.45
14	600325	华发股份	13,021,968.10	0.44
15	600887	*ST伊利	12,962,618.61	0.44
16	600426	华鲁恒升	12,942,071.74	0.44
17	000829	天音控股	12,746,683.66	0.43
18	600143	金发科技	11,932,046.24	0.41
19	600449	赛马实业	11,282,398.97	0.38
20	601166	兴业银行	9,805,517.67	0.33

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:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,501,431,904.11
卖出股票收入(成交)总额	549,074,993.76

注:"买入股票成本总额"和"卖出股票收入总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本期末未投资于债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本期末未投资于债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本期末未投资于资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本期末未投资于权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	71,825,962.62
3	应收股利	116,451.43
4	应收利息	365,150.29
5	应收申购款	2,896,916.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,204,480.37

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
33,070	81,915.54	460,872,857.61	17.01%	2,248,074,152.39	82.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金		97,179.26	0.00%
	合计	97,179.26	0.00%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年4月27日)基金份额总额	2,672,979,485.72
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	35,967,524.28
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,708,947,010.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 经本公司2008年度股东会批准,徐志光先生不再担任公司董事,胡奕钿先生不再担任公司独立董事,增补李兆会先生为公司董事,汪贻祥先生为公司独立董事;该变更事项已向相关监管部门备案。

10.2.2 经公司第四届董事会第一次会议审议批准鲁颂宾先生、魏瑛女士担任公司副总经理;该事项已获得监管部门核准,于2009年6月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站披露。

10.2.3 报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券股份有限公司	1	1,209,397,943.57	58.98	1,027,980.49	59.76	新增
兴业证券股份有限公司	1	605,092,592.14	29.51	491,643.85	28.58	新增
国信证券股份有限公司	1	236,016,362.16	11.51	200,613.53	11.66	新增
合 计	3	2,050,506,897.87	100.00	1,720,237.87	100.00	

券商名称	交易单元数量	回购交易		权证交易		备注
		成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	
中信证券股份有限公司	1	8,700,000,000.00	100.00	-	-	新增
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
合计	3	8,700,000,000.00	100.00	-	-	

注:1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后,确定证券经营机构的选择。经公司董事会批准后与被选择的证券经营机构签订协议。