银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年 12 月 31 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
报告送出日期:2011 年 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	10,650,228,872.97 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:本基金管理人在本基金的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	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	-527,592,687.32	809,933,062.58	-2,328,669,786.47
本期利润	-2,254,671,152.92	6,882,054,869.49	-9,787,316,099.25
加权平均基金份额本期利润	-0.1961	0.5326	-0.7429
本期加权平均净值利润率	-19.58%	55.29%	-82.11%
本期基金份额净值增长率	-18.01%	82.46%	-54.02%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	-903,516,719.15	-446,537,650.84	-4,728,215,916.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0848	-0.0370	-0.3751
期末基金资产净值	9,956,955,679.00	13,763,901,486.18	7,877,350,901.79
期末基金份额净值	0.9349	1.1402	0.6249
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	292.25%	378.39%	162.19%

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
过去三个月	-4.84%	1.70%	5.54%	1.77%	-10.38%	-0.07%
过去六个月	6.89%	1.43%	15.31%	1.52%	-8.42%	-0.09%
过去一年	-18.01%	1.43%	-19.18%	1.58%	1.17%	-0.15%
过去三年	-31.21%	1.88%	-48.42%	2.31%	17.21%	-0.43%
过去五年	265.67%	1.83%	154.57%	2.17%	111.10%	-0.34%
自基金合同生效日起至今	292.25%	1.68%	102.11%	2.01%	190.14%	-0.33%

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于 2010 年、2009 年、2008 年未进行利润分配。

§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 2010 年 12 月 31 日,本基金管理人管理着十七只开放式证券投资基金和一只创新型封闭式基金,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)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。
路志刚先生	本基金的基金经理。	2009年 6 月 8 日	2010 年 9 月 20 日	13年	博士学位,曾任广东建设实业集团公司财务主管,广州证券有限公司发行部、营业部经理,金鹰基金管理有限公司研究发展部副总监, 万家基金管理有限公司投资总监、基金经理等职。自 2006 年 4 月 29 日至 2008 年 9 月 27 日任万家增强收益债券型证券投资基金基金经理,自 2006 年 11 月 30 日至 2008 年 9 月 27 日任万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理。2009 年 1 月加盟银华基金管理有限公司,自 2009 年 10 月 14 日起至 2010 年 9 月 20 日兼任银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理,自 2010 年 5 月 7 日起至 2010 年 9 月 20 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
杨长清先生	本基金的基金经理。	2009 年 11 月 26 日	-	6年	硕士学历。曾任职于长沙铁路局担任机械设计工程师。2003 年 2 月加盟银华基金管理有限公司,历任市场营销部经理、产品开发部执行主管、研究部研究员及投资管理部基金经理助理。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公司作出决定之日。

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。

3、杨长清先生自 2011 年 1 月 7 日起不再担任本基金基金经理,详情请见本基金管理人发布的相关公告。

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 精选股票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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年国家政策主导经济结构调整,全年 A 股市场表现呈现冰火两重天的走势,沪深 300 指数和上证 50 指数股票的估值水平不足 15 倍,但指数表现较差,而估值非常高的小盘股和题材股,则表现为持续泡沫的特征。2010 年本基金主要投资方向是低估值蓝筹股,在 2010 年上半年投资了部分新兴产业的股票。在 2010 年三季度中期开始,由于我们认为新兴产业股票的相对估值已经很高,减持了新兴产业股票,将股票仓位集中到低估值周期性行业。

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 0.9349 元, 本报告期份额净值增长率为-18.01%, 同期业绩比较基准增长率为-19.18%。

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 年中国经济将受到通胀的考验,通胀和宏观调控的相互作用是 2011 年股市运行和发展的两大不确定因素。目前加息周期已经开启,国内的通胀形势有望得到有效的控制。从经济景气循环的观点来看,目前中国已经进入了新一轮的经济景气上升周期,随着通胀回落和经济见底回升,相对于流动性而言,经济周期力量对股市的影响将逐渐增强。目前权重股估值很低,下跌空间比较有限,我们认为 2011 年市场向上的可能性和空间会更大,与经济周期启动相关的周期性品种将有更多的投资机会。

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

本基金本报告期内依据基金合同约定和基金运作情况,未进行基金利润分配。

§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 审计报告

本基金 2010 年度财务会计报告经安永华明会计师事务所审计,注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告, 投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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: 2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	1,001,877,976.79	705,498,916.63
结算备付金	11,188,648.62	12,437,607.29
存出保证金	3,088,685.74	993,243.83
交易性金融资产	8,648,480,966.38	12,682,440,166.19
其中:股票投资	8,102,725,966.38	12,584,165,166.19
基金投资	-	-
债券投资	545,755,000.00	98,275,000.00
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	184,488,517.51
应收利息	13,850,794.45	903,564.93
应收股利	-	-
应收申购款	35,472,452.61	413,841,775.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,984,278,970.67	14,000,603,791.62
负债和所有者权益	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009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	-	164,524,757.96
应付赎回款	5,294,989.89	45,385,369.93
应付管理人报酬	10,522,768.98	13,540,117.81
应付托管费	2,192,243.52	2,820,857.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,953,210.64	8,993,636.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,360,078.64	1,437,565.85
负债合计	27,323,291.67	236,702,305.44
所有者权益:		
实收基金	10,650,228,872.97	12,071,458,576.92
未分配利润	-693,273,193.97	1,692,442,909.26
所有者权益合计	9,956,955,679.00	13,763,901,486.18
负债和所有者权益总计	9,984,278,970.67	14,000,603,791.62

注:报告截止日 2010 年 12 月 31 日,基金份额净值为人民币 0.9349 元,基金份额总额为 10,650,228,872.97 份。

7.2 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:2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	-2,032,403,776.47	7,090,738,577.50
1.利息收入	26,862,168.21	7,701,447.02
其中:存款利息收入	7,555,433.84	5,486,116.95
债券利息收入	19,306,734.37	2,215,330.07
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)	-334,336,972.97	1,005,236,160.76
其中:股票投资收益	-406,337,632.40	861,019,714.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-5,270,015.43	33,731,318.53
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	77,270,674.86	110,485,127.86
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,727,078,465.60	6,072,121,806.91
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,149,493.89	5,679,162.81
减:二、费用	222,267,376.45	208,683,708.01
1.管理人报酬	138,415,213.44	147,846,036.94
2.托管费	28,836,502.76	30,801,257.60
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	54,545,285.68	29,571,089.63
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	470,374.57	465,323.84
三、利润总额	-2,254,671,152.92	6,882,054,869.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,254,671,152.92	6,882,054,869.49

7.3 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:2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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)	-	-2,254,671,152.92	-2,254,671,152.92
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)	-1,421,229,703.95	-131,044,950.31	-1,552,274,654.26
其中:1.基金申购款	1,842,679,256.80	-902,172.01	1,841,777,084.79
2.基金赎回款	-3,263,908,960.75	-130,142,778.30	-3,394,051,739.05
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)	10,650,228,872.97	-693,273,193.97	9,956,955,679.00
项目	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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)	12,605,566,818.45	-4,728,215,916.66	7,877,350,901.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,882,054,869.49	6,882,054,869.49
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)	-534,108,241.53	-461,396,043.57	-995,504,285.10
其中:1.基金申购款	5,769,815,405.97	17,789,218.49	5,787,604,624.46
2.基金赎回款	-6,303,923,647.50	-479,185,262.06	-6,783,108,909.56
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)	12,071,458,576.92	1,692,442,909.26	13,763,901,486.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华-道琼斯 88 精选证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字 200482 号文《关于同意银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的批复》的核准,由银华基金管理有限公司于 2004 年 7 月 5 日至 2004 年 8 月 5 日向社会公开发行募集, 基金合同于 2004 年 8 月 11 日正式生效, 首次设立募集规模为 1,085,604,444.01 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括道琼斯中国 88 指数的成份 A 股及其备选成份股、新股(首发或增发)、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债等债券资产)以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。在资产类别配置上,本基金股票资产投资比例上限为 95%,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。本基金的股票选择主要依据入选道琼斯中国 88 指数的成份股和备选成份股,且对标的指数成份股的投资不少于 62 只,对标的指数成分股以外的股票投资不高于股票投资资产总额的 40%。本基金以道琼斯中国 88 指数为标的指数,但基金管理人可以按照本基金合同规定的程序变更标的指数。本基金的业绩比较基准与标的指数的定义相同。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(统称"企业会计准则")、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司及债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自 2005 年 6 月 13 日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按 50%计算应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(原西南证券有限责任公司"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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	1,157,053,663.89	3.31	562,806,793.82	2.93
第一创业	2,426,054,841.76	6.95	715,726,361.51	3.73
东北证券	1,454,784,326.56	4.17	1,047,622,815.38	5.46

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
西南证券	-	-	6,965,077.60	0.49

注:本基金于 2010 年度未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 权证交易

本基金于 2010 年度及 2009 年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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(%)
西南证券	983,491.12	3.36	54,882.57	0.69
第一创业	2,062,142.76	7.05	-	-
东北证券	1,200,384.03	4.10	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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(%)
西南证券	478,384.51	2.97	478,384.51	5.32
第一创业	608,363.55	3.77	230,507.78	2.56
东北证券	851,201.31	5.28	851,201.31	9.46

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	138,415,213.44	147,846,036.94
其中:支付给销售机构的客户维护费	18,692,631.08	19,455,517.09

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.20%/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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,836,502.76	30,801,257.60

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于 2010 年度及 2009 年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2010 年度及 2009 年度均未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 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 2010 年末及 2009 年末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	1,001,877,976.79	7,255,928.36	705,498,916.63	5,160,934.65

7.4.8.6 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 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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)	总金额
东北证券	600089	特变电工	增发	463,665	7,455,733.20

注:本基金于 2009 年度未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2010年 9 月 29 日	2011年 1 月 13 日	新股流通受限	10.00	16.20	755,747	7,557,470.00	12,243,101.40	-
002500	山西证券	2010年 11 月 3 日	2011年 2 月 15 日	新股流通受限	7.80	12.16	61,011	475,885.80	741,893.76	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 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正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金并无须作说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	8,102,725,966.38	81.15
	其中:股票	8,102,725,966.38	81.15
2	固定收益投资	545,755,000.00	5.47
	其中:债券	545,755,000.00	5.47
	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	1,013,066,625.41	10.15
6	其他各项资产	322,731,378.88	3.23
7	合计	9,984,278,970.67	100.00

8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

8.2.1 期末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	3,509,900.00	0.04
C	制造业	552,320,005.85	5.55
C0	食品、饮料	320,548,148.13	3.22
C1	纺织、服装、皮毛	109,200.00	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	854,300.00	0.01
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,076,700.00	0.02
C7	机械、设备、仪表	2,284,200.00	0.02
C8	医药、生物制品	226,447,457.72	2.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	163,900.00	0.00
E	建筑业	261,300.00	0.00
F	交通运输、仓储业	443,848.00	0.00
G	信息技术业	590,325,796.85	5.93
H	批发和零售贸易	631,684,520.64	6.34
I	金融、保险业	5,529,143,625.52	55.53
J	房地产业	690,300.00	0.01
K	社会服务业	121,500.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	119,800.00	0.00
	合计	7,308,784,496.86	73.40

8.2.2 期末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	-	-
C	制造业	487,498,198.50	4.90
C0	食品、饮料	-	-
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	487,352,698.50	4.89
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	145,500.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	76,300.00	0.00
E	建筑业	90,800.00	0.00
F	交通运输、仓储业	179,400.00	0.00
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	225,539,096.62	2.27
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	80,557,674.40	0.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	793,941,469.52	7.97

8.3 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

8.3.1 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	16,800,000	943,488,000.00	9.48
2	600000	浦发银行	64,165,982	795,016,516.98	7.98
3	600030	中信证券	49,607,278	624,555,630.02	6.27
4	601601	中国太保	26,497,588	606,794,765.20	6.09
5	600036	招商银行	46,549,911	596,304,359.91	5.99
6	600050	中国联通	110,240,691	589,787,696.85	5.92
7	600016	民生银行	100,259,918	503,304,788.36	5.05
8	601166	兴业银行	18,271,423	439,427,723.15	4.41
9	002024	苏宁电器	33,000,000	432,300,000.00	4.34
10	000001	深发展 A	25,025,982	395,160,255.78	3.97

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(http://www.yhfund.com.cn)的年度报告正文。

8.3.2 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	000012	南 玻 A	24,676,086	487,352,698.50	4.89
2	000776	广发证券	3,999,889	212,554,101.46	2.13
3	000598	兴蓉投资	3,904,880	80,557,674.40	0.81
4	601377	兴业证券	755,747	12,243,101.40	0.12
5	002500	山西证券	61,011	741,893.76	0.01

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(http://www.yhfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600050	中国联通	735,732,046.77	5.35
2	600030	中信证券	726,070,704.57	5.28
3	601601	中国太保	623,706,706.09	4.53
4	600739	辽宁成大	602,494,677.41	4.38
5	601166	兴业银行	514,541,558.01	3.74
6	601628	中国人寿	479,617,086.86	3.48
7	000001	深发展 A	477,133,838.50	3.47
8	600036	招商银行	471,606,316.02	3.43
9	600000	浦发银行	461,420,988.16	3.35
10	600015	华夏银行	446,413,472.10	3.24
11	600048	保利地产	440,116,286.30	3.20
12	601318	中国平安	428,460,561.91	3.11
13	600837	海通证券	413,205,285.70	3.00
14	600016	民生银行	365,891,504.34	2.66
15	600100	同方股份	332,394,955.58	2.41
16	600884	杉杉股份	313,869,411.65	2.28
17	000878	云南铜业	300,202,898.67	2.18
18	000623	吉林敖东	284,166,851.66	2.06
19	600383	金地集团	277,457,860.93	2.02
20	601288	农业银行	239,714,258.28	1.74

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。

8.4.2 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	601628	中国人寿	654,799,634.27	4.76
2	600048	保利地产	457,549,301.31	3.32
3	600519	贵州茅台	440,634,144.45	3.20
4	000157	中联重科	400,838,697.59	2.91
5	600031	三一重工	395,543,678.59	2.87
6	600036	招商银行	383,502,586.75	2.79
7	600547	山东黄金	368,561,260.46	2.68
8	600309	烟台万华	367,496,306.14	2.67
9	000060	中金岭南	361,748,019.21	2.63
10	600104	上海汽车	357,605,149.97	2.60
11	000878	云南铜业	354,815,705.38	2.58
12	600837	海通证券	349,201,903.54	2.54
13	601088	中国神华	345,174,053.00	2.51
14	600030	中信证券	339,298,856.23	2.47
15	600884	杉杉股份	338,820,743.34	2.46
16	000063	中兴通讯	326,416,726.39	2.37
17	600100	同方股份	322,835,075.96	2.35
18	600739	辽宁成大	321,793,222.78	2.34
19	600383	金地集团	310,355,908.44	2.25
20	600016	民生银行	291,195,750.99	2.12

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。

8.4.3 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	16,353,605,400.98
卖出股票收入(成交)总额	18,703,429,424.22

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	545,755,000.00	5.48
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	545,755,000.00	5.48

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801041	08央行票据 41	1,500,000	150,510,000.00	1.51
2	1001011	10央行票据 11	1,500,000	146,880,000.00	1.48
3	0801044	08央行票据 44	1,000,000	100,360,000.00	1.01
4	1001021	10央行票据 21	1,000,000	97,810,000.00	0.98
5	0801047	08央行票据 47	500,000	50,195,000.00	0.50

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,088,685.74
2	应收证券清算款	270,319,446.08
3	应收股利	-
4	应收利息	13,850,794.45
5	应收申购款	35,472,452.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	322,731,378.88

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601377	兴业证券	12,243,101.40	0.12	新股流通受限
2	002500	山西证券	741,893.76	0.01	新股流通受限

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
649,025	16,409.58	689,557,848.90	6.47%	9,960,671,024.07	93.53%

9.2 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	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	1,190,940.99	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2004 年 8 月 11 日)基金份额总额	1,085,604,444.01
本报告期期初基金份额总额	12,071,458,576.92
本报告期基金总申购份额	1,842,679,256.80
减:本报告期基金总赎回份额	3,263,908,960.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,650,228,872.97

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

11.2.1.1 2011 年 1 月 8 日,本基金管理人发布关于公司副总经理离任的公告,经本公司董事会批准,魏瑛女士不再担任本基金管理人公司副总经理职务。该变更事项已向相关监管部门备案,并于 2011 年 1 月 8 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站进行了披露;

11.2.1.2 2011 年 2 月 1 日,本基金管理人发布关于公司副总经理离任的公告,经本公司董事会批准,石松鹰先生不再担任本基金管理人公司副总经理职务。该变更事项已向相关监管部门备案,并于 2011 年 2 月 1 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站进行了披露。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.2.1 本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务;

11.2.2.2 本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

11.3 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,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所, 报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 105,000.00 元。目前的审计机构已连续为本基金提供 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
国金证券股份有限公司	2	3,903,562,384.66	11.18%	3,197,292.58	10.92%	-
德邦证券有限责任公司	1	3,317,118,763.32	9.50%	2,819,538.76	9.63%	-
安信证券股份有限公司	3	3,180,762,830.60	9.11%	2,703,625.71	9.24%	-
第一创业证券有限责任公司	2	2,426,054,841.76	6.95%	2,062,142.76	7.05%	-
光大证券股份有限公司	2	2,217,776,844.21	6.35%	1,825,929.03	6.24%	-
招商证券股份有限公司	2	2,018,100,478.42	5.78%	1,671,619.65	5.71%	-
渤海证券股份有限公司	1	2,004,735,954.85	5.74%	1,704,015.51	5.82%	-
方正证券股份有限公司	1	1,815,063,070.87	5.20%	1,542,788.26	5.27%	-
兴业证券股份有限公司	3	1,531,996,856.60	4.39%	1,254,385.93	4.29%	新增 1 个交易单元
东北证券股份有限公司	3	1,454,784,326.56	4.17%	1,200,384.03	4.10%	-
中国国际金融有限公司	2	1,417,878,409.25	4.06%	1,205,192.01	4.12%	-
新时代证券有限责任公司	1	1,397,704,866.46	4.00%	1,188,036.79	4.06%	-
西南证券股份有限公司	1	1,157,053,663.89	3.31%	983,491.12	3.36%	-
中国民族证券有限责任公司	1	1,151,029,123.46	3.30%	978,376.25	3.34%	-
宏源证券股份有限公司	2	972,670,289.54	2.79%	790,302.40	2.70%	新增 1 个交易单元
湘财证券有限责任公司	1	838,316,448.32	2.40%	712,556.64	2.43%	-
华泰联合证券有限责任公司	2	626,909,540.80	1.80%	511,924.53	1.75%	-
申银万国股份有限公司	1	544,437,383.06	1.56%	462,771.54	1.58%	-
国信证券股份有限公司	1	532,725,080.12	1.53%	432,843.17	1.48%	-
长江证券股份有限公司	2	469,904,745.55	1.35%	398,451.39	1.36%	-
广发证券股份有限公司	1	362,697,282.37	1.04%	308,292.48	1.05%	-
红塔证券股份有限公司	2	270,987,197.76	0.78%	220,180.81	0.75%	新增 2 个交易单元
中信证券股份有限公司	3	255,894,270.75	0.73%	217,507.90	0.74%	新增 1 个交易单元
西部证券股份有限公司	1	233,082,424.51	0.67%	198,120.03	0.68%	新增 1 个交易单元
东方证券股份有限公司	2	196,074,134.40	0.56%	159,310.01	0.54%	新增 2 个交易单元
北京高华证券有限责任公司	1	192,120,606.51	0.55%	163,301.93	0.56%	-
中银国际证券有限责任公司	3	163,734,231.92	0.47%	133,034.30	0.45%	新增 1 个交易单元
长城证券有限责任公司	2	111,535,103.69	0.32%	90,622.99	0.31%	-
华宝证券有限责任公司	1	88,594,430.17	0.25%	75,303.10	0.26%	-
中信万通证券有限责任公司	1	68,843,951.32	0.20%	55,936.22	0.19%	-
中国建银证券投资有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限公司公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增 1 个交易单元

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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	8,537,621.50	100.00%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国建银证券投资有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限公司公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 本基金管理人无影响投资者决策的其他重要信息

12.2 本基金托管人影响投资者决策的其他重要信息披露如下:

12.2.1 2010 年 1 月 29 日,本基金托管人发布第二届董事会第二十八次会议决议公告,决议聘任庞秀生先生担任本行副行长;

12.2.2 2010 年 5 月 13 日,本基金托管人发布关于高级管理人员辞任的公告,范一飞先生已提出辞呈,辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务;

12.2.3 2010 年 6 月 21 日,本基金托管人发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告;

12.2.4 2010 年 7 月 1 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告,每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税);

12.2.5 2010 年 9 月 15 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布公告,张福荣先生担任本行监事长,谢渡扬先生辞去本行监事、监事长职务;

12.2.6 2010 年 11 月 2 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

银华基金管理有限公司
2011年 3 月 30 日