银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

基金管理人:銀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 报告送出目第201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	4性承担
·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。	
基金托管人中国工商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、禾	川润分配
6亿、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。	

2.1 基金基本情况			§2 基金简介		
基金简称			银华和谐主题混合		
基金主代码			180018		
基金运作方式			契约型开放式		
基金合同生效日			2009年4月27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		
报告期末基金份额总额			1,191,576,838.81 份		
基金合同存续期			不定期		
2.2 基金产品说明					
投资目标		Jan 1415	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。 ,改善其经济效益;这些行业中的龙头企业分	
投资策略		資产配置鄉終,注重原陰与與此益的字緒,進点財役至益于 构建的增长会。或策和共业的银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生 住。 未基金的投资比例为,思票等权益类资产占基金资产出效为30%—30%。佛等等固定收益类资产占基金资产比较为50%—60%,现金或者到明日在一年以内的政府债券不同于基金资产净值的5%。			
业绩比较基准					
风险收益特征		水平高	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 平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。		
2.3 基金管理人和法	金托管人	<u> </u>			
項	Ħ		基金管理人	基金托管人	
名称		4	根华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
	姓名		凌宇翔	赵会军	
信息披露负责人	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 400		06783333, 010)85186558	95588		
传真			010)58163027	010-66105798	
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	it.	htt	p://www.yhfund.com.cn	
the A december legal decimal to the					

3.1 主要会计数据和财务指标		金额单位:人民币:
3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年4月27日 (基金合同生效日)至 2009 年12月31日
本期已实现收益	172,071,616.40	327,547,192.34
本期利润	93,639,284.31	458,107,877.21
加权平均基金份额本期利润	0.0521	0.254
本期加权平均净值利润率	4.56%	24.059
本期基金份額净值增长率	2.08%	24.209
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	212,155,407.91	98,792,373.3
期末可供分配基金份額利润	0.1780	0.104
期末基金资产净值	1,403,732,246.72	1,096,195,519.4
期末基金份额净值	1.178	1.15
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	26.78%	24.209

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、平板百所列示 列数字。	的旅速业项相外	N型括付有人父参	杰亚的合坝坎州,	例如: 恋亚的中购员	英国货等,订入货用归头	阿収益水平安
3.2 基金净值表	现 争值增长率及其与	restro material de la company	halfe-Maska Afri Lafeb			
	が が が が が が が が が が が が が が	回朔亚顼CXなる 份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准收		
阶段	*0	率标准差②	收益率3	益率标准差④	D-3	2-4
过去三个月	1.55%	1.62%	2.75%	0.98%	-1.20%	0.64%
过去六个月	15.04%	1.40%	11.26%	0.86%	3.78%	0.54%
过去一年	2.08%	1.33%	-5.57%	0.87%	7.65%	0.46%
自基金合同生效日 起至今	26.78%	1.25%	14.32%	0.97%	12.46%	0.28%
注, 本北久市傳	→お其地 为、治器:	nn ticknihr-k-sic	56. 市田债券首1	与物价分头或 4502 十	干木北久均次干奶西菜	切头米洛本上其本边

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月內为建仓期。建仓期结束到本基金的名项股资比例已达到基金合同第十一条:基金的股资 C 股投资阻据现产的条种比例,显常权益发资产占基金资产比例为 30%-80%、债券等固定收益类资产占基金资产比例为 15%-65%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产单位的 5%。32.3 日基金合用生效以来基金每年单位储气来及其间则显微比较基础改革单的比较

注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。 3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	年10 衍為並衍額分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注	
2010	-	-	-	-	-	
2009	0.800	124,551,279.70	49,795,145.66	174,346,425.36	-	
合计	0.800	124,551,279.70	49,795,145.66	174,346,425.36	-	
\$4 管理人报告 4.1 基金管理人及其管理基金的经验 41.1 基金管理人及其管理基金的经验 41.1 基金管理人及其管理基金的经验 41.1 基金管理人及其管理基金的经验 41.1 基金管理人及其管理基金的经验						

姓名	职务	任本基金的基金经	理(助理)期限	证券从业	逆明
XE/EI	87.95	任职日期	离任日期	年限	19093
陆文俊先生	本基金的基金 经理、公司总 经理助理。	2009年4月27日	-	9年	学士学化。曾任哲文证券有限责任公司人力资源部产 放主管、交易部定型、海军中创建管理事务所令人 人名国基金管理有限公司支易员、先吴证券有限责任 化公司投资证金、资产管理部间企业,自2006年7月6日至 2008年6月9日 (1917年)。1918年6日 (1918年) 1918年6日 (1918年) (1918年)
邹积建先生	本基金的基金 经理助理	2010年 6 月 24 日	-	11年	硕士学位。1999年至2010年先后在中信证券、富国基金、民生证券、益民基金、华夏基金从事研究、投资等相关工作。2010年6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、此效	上的任职日期和	國任日期均指基金合同。	主效日或公司作出	决定之日。	共有从业页恰。四箱: 中国。

的股場行情。 本基金在2010年的组合配置侧重于价值型的低估值品种,以大机械、金融、地产为布局重点,同时兼顺电子元器件、软件服务、移动通讯服务等放长性行业;医药、消费等稳定增长类行业配置较少,创业板、中小板的配置比例不高。

本基金位 2010年的现任企宜测算于价值到的低估值品种。以大型级金融、地产分析局重点、同时兼顺电子无器件、软件服务、移动通 "服务等成长性疗业。还我,消费等起空增长天产业处理数少。如此是 中小物的企置比例不高。 4.2 报告附对基金的业绩表现 4.2 报告附对基金的业绩表现 4.5 智慧人对支速经济。证券市场及行业业场的高度接近 4.6 智慧人对支速经济。证券市场及行业业场的高度接近 展现 2011年,决于阿斯堡的大型 2007年即总、统行者所属生产现 2008年那么不。经济制度力度 2009年那么是。除了基础会是一个问 展现 2011年,实计阿斯堡的关键。2007年即总、统行者所属生产和 2008年那么多。经济基础的发生 2009年那么是。除了基础会是一个问 展现 2011年,实计阿斯堡的基础。因为大量监督和电话,还有各种基础上不可未必得的基础。这种交流强能和主义经验和创新,是必须能够的。 2017年,全部人对格场是,是一种企业分别,但不是一个现代。 2017年,全部人对格场是,是一种企业分别,是一种企业的企业,是一种企业的企业。 2017年,

以以、 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与调分配情况的识别 本基金本报告期内依据基金与同的实定和基金运作情况,未进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人遗嘱宁信情况再明
25.1 报告期内本基金托管人遗嘱宁信情况再明
2010年、本基金行管人在对增年和世期层活置混合管证券收费基金的托管过程中,严格遵守 征季投资基金法 及其他法律法规
和基金合同的存货规定。不存在作用增基金的部特有人利益的行为、企业保职及带地履行了基金托管 自成中的文字。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作建康宁信。净值计算、原则分配等情况的说明
2010年、银矿时阻于超灵活在整混合企业等效量基金的管理人一维华基金管理中积公司在银年和谐主超灵活危置混合型证券投资
基金的投资运作。基金资产净值计算、基金份额申取赎回价格计算、基金费用于文等问题上,不存在任何期常基金份据特有人利益的行为。
在各重要方面的定件严税权盈益金合同的规定过行。本报告期内、银矿和压进型点态度混合企业等效金金未进行的成分。
5.3 托管人对本年度报告中报务信息与常的真实。根据特定整文意思是
本托管人及对本年度报告中报务信息与常的真实。根据特定整文意思是
基本托管人成立对继某基金管理和设立自编和报金资金等,在成功,是成功和工程设备。
4. 在第一次 对本年度报告中财务信息,投资组合报告等将基本行"常度"从上内容等集、通畅和完整。
本基金200年度财务分析报告、投资组合报告等将基础了"常度"从上内容等集、通畅和完整。
本基金200年度财务会计报告、投资组合报告等将基础了"常度"从上内容等集、通畅和完整。
本基金200年度财务会计报告、投资组合报告等将基础了"常度"从上内容等集、通畅和完整。
在基金200年度财务会计报告、投资组合报告等将基础了"常度"从上内容等集、通畅和完整。

7.1 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: 2010 年 12 月 31 日

		単位:人民市
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	86,502,574.02	80,671,077.4
结算备付金	1,728,406.28	626,780.0
存出保证金	1,285,991.48	1,287,480.6
交易性金融资产	1,301,954,260.74	1,024,386,996.1
其中:股票投资	1,018,164,124.42	816,956,996.1
基金投资	-	
债券投资	283,790,136.32	207,430,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	14,841,343.91	3,896,558.20
应收利息	3,655,184.26	948.475.80
应收股利	-	-
应收申购款	672,791.22	713,185.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,410,640,551.91	1,112,530,554.0
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	-	3,893,146.0
应付赎回款	1,834,404.20	9,432,994.4
应付管理人报酬	2.042.375.80	1,423,071.6
应付托管费	340,395.97	237,178.60
应付销售服务费	-	
应付交易费用	2,331,371.18	993.093.2
应交税费	-	
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	359,758.04	355,550.6
负债合计	6,908,305.19	16,335,034.6
所有者权益:		
实收基金	1,191,576,838.81	950,084,328.6
未分配利润	212,155,407.91	146,111,190.76
所有者权益合计	1,403,732,246.72	1,096,195,519.4
负债和所有者权益总计	1,410,640,551.91	1,112,530,554.0

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	单位:人民币元 上年度可比期间 2009年4月27日 健金合同生效 日)至2009年12月31日
一、收人	144,307,042.09	489,762,048.86
1.利息收入	8,894,311.95	5,738,675.77
其中:存款利息收入	1,120,615.80	3,964,424.74
债券利息收入	7,773,696.15	1,140,497.03
资产支持证券利息收入	-	
买人返售金融资产收人	-	633,754.00
其他利息收入	-	
2.投资收益 损失以 ""填列)	210,818,553.50	350,649,746.05
其中:股票投资收益	196,825,934.31	345,023,076.54
基金投资收益	-	
债券投资收益	1,168,028.39	-10,995.60
资产支持证券投资收益	-	
衍生工具收益	-	-
股利收益	12,824,590.80	5,637,665.11
3.公允价值变动收益 损失以 ""号填列)	-78,432,332.09	130,560,684.87
4. 汇兑收益 假失以"_"号填列)	-	
5.其他收入 损失以 ""号填列)	3.026.508.73	2,812,942.17
减:二、费用	50,667,757.78	31,654,171.65
1.管理人报酬	30,750,279.97	19,319,954.89
2.托管费	5,125,046.69	3,219,992.42
3.銷售服务费	=	-
4.交易费用	14,348,273.73	8,817,828.40
5.利息支出	1,222.65	-
其中:卖出回购金融资产支出	1,222.65	-
6.其他费用	442,934.74	296,395.94
三、利润总额	93,639,284.31	458,107,877.21
减:所得税费用	=	-
四、净利润(铮亏损以""号填列)	93,639,284.31	458, 107, 877.21

7.3 所有者权益 健金净值)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:2010年1月1日至 2010年12月31日

頂目	20	本期 10年1月1日至2010年12月31	H	
	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)	950,084,328.65	146, 111, 190.76	1,096,195,519.41	
二、本期经营活动产生的基金净值变 动数 (本期利润)	=	93,639,284.31	93,639,284.31	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (争值减少以""号填列)	241,492,510.16	-27,595,067.16	213,897,443.00	
其中:1.基金申购款	2,411,212,838.50	369,609,781.88	2,780,822,620.38	
2.基金赎回款	-2,169,720,328.34	-397, 204, 849.04	-2,566,925,177.38	
四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动(争值减少以"" 号填列)	=	-	-	
五、期末所有者权益(基金净值)	1,191,576,838.81	212, 155, 407.91	1,403,732,246.72	
项目	上年度可比期间 2009年 4 月 27 日 (蘇金合同生效日)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)	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)	=	458,107,877.21	458,107,877.21	
三、本期基金份额交易产生的基金净 值变动数 (争值减少以""号填列)	-1,722,895,157.07	-137,650,261.09	-1,860,545,418.16	
其中:1.基金申购款	266,464,749.32	20,369,701.68	286,834,451.00	
2.基金赎回款	-1,989,359,906.39	-158,019,962.77	-2,147,379,869.16	
四、本期向基金份额持有人分配利润 产生的基金净值变动(争值减少以"" 号填列)	=	-174,346,425.36	-174,346,425.36	
五、期末所有者权益(基金净值)	950.084.328.65	146, 111, 190, 76	1.096.195.519.41	

本报告 7.1 至 7.4 財务报表由下列负责人签署。 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会讲机构负责人 7.4 报规制注

制]。 本財务报表以本基金特续经营为基础列报。 7-43 遵循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 年度的经营成果和争值 1-25-1

本基金本格告期间无需要说明的会计估计变更事项。
7-45.3 差错更2的说明
本基金本格告期间无需要说明的差错更正事项。
7-46 税项
0 \$可花规
6 \$17.46 税项
0 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$17.02
6 \$1

7.4.7 天跃万天糸	
关联方名称	与本基金的关系
s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
等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
R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
」西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
以华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
	基金托管人、基金代銷机构

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制间的关键扩交易 7.4.8 本报告期及上年度可比制间的关键扩交易 7.4.8 油缸关键扩交易开进行的支档 系基金 2010 年 4 月 27 日 低金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止会计期间均未通过关联方交易单元进行交易。 7.4.8.2 大阪大衛衛 7.4.8.2 未签管理模

		单位:人民币元
項目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年 4 月 27 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	30,750,279.97	19,319,954.89
其中:支付给销售机构的客户维护费	3,940,442.62	4,346,762.80
	管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年	费率计提。计算方法如下:
H=E×1.50%/当年天数 H 为每日应支付的基金管理费		

E.为丽一日的基金资产净值 基金管理人的管理费每日计算,逐 管理人。 7.4.8.2.2 基金托管费	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 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 4 月 27 日 儘金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
的期发生的基金应支付的托管费	5,125,046.69	3,219,992.42
注:基金托管费按前一日的基金资 H=Ex0.25%/当年天数 H 为每日应支付的基金托管费	产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下	:

E 为前一日的基金资产净值 基金柱管费每日计算,逐日累计至每月月底,接月支付;由基金柱管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。 7-48.3 与美玩产品银行间到业市场的债券 绘回响 交易 本基金于 2010 年度及目 2009 年 4 月 27 日 低金台同生效日 1至 2009 年 12 月 31 日均未与关联方进行银行间同业市场的债券 绘回

2010年1月1日至2010年12月31日 发行方式

		8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	=	-
С	制造业	458,626,855.28	32.67
C0	食品、饮料	38,192,767.80	2.72
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	93,509,768.11	6.66
C5	电子	48,158,847.50	3.43
C6	金属、非金属	95,476,125.50	6.80
C7	机械、设备、仪表	138,911,828.65	9.90
C8	医药、生物制品	44,377,517.72	3.16
C99	其他制造业	-	=
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,715,000.00	0.41
F	交通运输、仓储业	-	=
G	信息技术业	168,949,145.37	12.04
Н	批发和零售贸易	88,459,242.92	6.30
I	金融、保险业	46,293,533.63	3.30
J	房地产业	169,493,015.08	12.07
K	社会服务业	80,627,332.14	5.74
L	传播与文化产业	-	=
M	综合类	-	=
	A 11		

8.3 391	本按公元[J门且由	本金)((一)中国几)((人) (4年)	20/98	金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	000012	南玻A	4,378,538	86,476,125.50	6.16
2	300002	神州泰岳	1,387,108	77,525,466.12	5.52
3	600570	恒生电子	3,722,157	75,373,679.25	5.37
4	600383	金地集团	10,999,871	67,979,202.78	4.84
5	002024	苏宁电器	5,137,168	67,296,900.80	4.79
6	600104	上海汽车	4.056.620	59,551,181.60	4.24
7	600703	三安光电	1,295,506	59,411,905.16	4.23
8	000002	万 科 A	5,999,965	49,319,712.30	3.51
9	002106	莱宝高科	726,926	48,158,847.50	3.43
10	000581	威孚高科	1,096,700	40,742,405.00	2.90
34 t/L	25年まなり アタカオーセス	生物士甘瓜机次品	成立之前 西西斯州 计设计表文数	エオせん然即し切かし。	1 WATERLATE

	1000011400	1000 A 11	-1-9924CF1 3-C7 Calcage	(%)
1	600000	浦发银行	226,809,150.51	20.69
2	600104	上海汽车	170,085,103.67	15.52
3	600036	招商银行	136,387,523.76	12.44
4	601166	兴业银行	119,694,844.07	10.92
5	300002	神州泰岳	110,180,893.75	10.05
6	000001	深发展 A	107.697.297.94	9.82
7	000060	中金岭南	97,083,722.75	8.86
8	600019	宝钢股份	91,951,480.96	8.39
9	000002	万科A	90,981,201.86	8.30
10	000338	潍柴动力	89,421,271.67	8.16
11	601106	中国一重	86.863.054.74	7.92
12	002024	苏宁电器	86,123,764.49	7.86
13	600303	曙光股份	80,845,537.64	7.38
14	000422	湖北宜化	80,692,719.92	7.36
15	600739	辽宁成大	78,817,364.19	7.19
16	600383	金地集团	73,892,933.12	6.74
17	600048	保利地产	68,142,982.58	6.22
18	000800	一汽轿车	66,938,959.62	6.11
19	600030	中信证券	66,037,859.16	6.02
20	000069	华侨城 A	65,939,242.46	6.02
21	600570	恒生电子	65,790,752.08	6.00
22	600370	格力地产	62,245,718.49	5.68
22	600185		62,245,718.49	5.68
		同方股份		
24	600123		60,086,032.03	5.48
25	600518	康美药业	57,984,716.40	5.29
26	600660	福耀玻璃	57,458,418.81	5.24
27	601186	中国铁建	57,117,202.87	5.21
28	600035	楚天高速	54,723,362.13	4.99
29	601390	中国中铁	52,978,460.28	4.83
30	600166	福田汽车	50,632,589.67	4.62
31	600523	贵航股份	49,901,053.93	4.55
32	600150	中国船舶	48,475,300.77	4.42
33	002106	莱宝高科	47,132,419.43	4.30
34	000012	南玻A	46,797,595.80	4.27
35	002344	海宁皮城	46,244,695.08	4.22
36	000527	美的电器	45,627,231.09	4.16
37	000917	电广传媒	45,551,223,76	4.16
38	300027	华谊兄弟	44,915,640.17	4.10
39	601009	南京银行	43,936,954,77	4.10
		南风股份	.,,	
40	300004		43,106,830.42	3.93
41	600884	杉杉股份	41,939,013.98	3.83
42	600837	海通证券	41,333,175.92	3.77
43	000024	招商地产	41,262,668.31	3.76
44	002202	金风科技	40,815,411.35	3.72
45	600362	江西铜业	40,740,640.10	3.72
46	600195	中牧股份	39,594,010.76	3.61
47	000972	新中基	39,414,393.95	3.60
48	600309	烟台万华	39,358,175.53	3.59
49	600703	三安光电	38,626,594.99	3.52
50	000050	深天马 A	37.921.498.83	3.46
51	600050	中国联通	37,265,375.59	3.40
52	600096	云天化	36,825,660.38	3.36
53	000425	徐工机械	35,133,455.62	3.21
54	600153	建发股份	32,610,913.11	2.97
54	600153			2.97
		好当家	31,771,983.15	
56	002041	登海种业	29,239,961.16	2.67
57	601168	西部矿业	29,135,950.53	2.66
58	600521	华海药业	28,657,576.10	2.61
59	600893	航空动力	28,371,600.12	2.59
60	000581	威孚高科	26,524,800.55	2.42
61	600366	宁波韵升	26,462,075.46	2.41
62	000997	新大陆	25,692,227.16	2.34
63	000630	铜陵有色	25,042,771.92	2.28
64	000537	广宇发展	24,890,281.62	2.27
65	002214	大立科技	23,848,342.89	2.18
66	600795	国电电力	23,115,691.81	2.11
67	601668	中国建筑	22,980,000.00	2.11
60	600067	TT 1/10/025-0%	22,980,000.00	2.10

1	600000	浦发银行	213,492,636.68	19.4
2	600104	上海汽车	159,171,914.14	14.5
3	600036	招商银行	153,561,253.22	14.0
4	601166	兴业银行	135,514,260.40	12.3
5	000338	潍柴动力	133,316,786.09	12.1
6	600019	宝钢股份	113,795,432.51	10.3
7	000001	深发展 A	105,724,939.60	9.6
8	000060	中金岭南	88,926,289.06	8.1
9	601106	中国一重	87,777,956.89	8.0
10	600303	曙光股份	84,478,665.18	7.7
11	600660	福耀玻璃	82,409,756.77	7.5
12	000527	美的电器	81,094,220.88	7.4
13	000422	湖北宜化	80,568,422.41	7.3
14	002024	苏宁电器	79,793,751.82	7.2
15	600523	贵航股份	68,504,713.01	6.2
16	600100	同方股份	68,321,825.99	6.2
17	000425	徐工机械	66,160,612.60	6.0
18	600035	楚天高速	64,287,329.95	5.8
19	600518	康美药业	59,847,644.83	5.4
20	601390	中国中铁	57,442,898.52	5.2
21	601186	中国铁建	57,383,629.01	5.2
22	600166	福田汽车	57,060,700.27	5.2
23	000917	电广传媒	56,067,348.93	5.1
24	300027	华谊兄弟	54,708,892.96	4.9
25	600048	保利地产	54,339,966.04	4.9

26	600123	兰花科创	54,263,496.62	4.95
27	300004	南风股份	52,614,716.98	4.80
28	002344	海宁皮城	50,266,575.61	4.59
29	000800	一汽轿车	49,841,793.39	4.55
30	000050	深天马 A	48,809,296.83	4.45
31	600739	辽宁成大	47,393,677.82	4.32
32	600309	烟台万华	47,175,994.68	4.30
33	600884	杉杉股份	45,508,684.44	4.15
34	600150	中国船舶	44,148,699.45	4.03
35	002041	登海种业	43,818,104.82	4.00
36	600195	中牧股份	41,248,051.27	3.76
37	600362	江西铜业	41,114,813.83	3.75
38	600030	中信证券	40,861,305.00	3.73
39	000157	中联重科	40,209,658.04	3.67
40	601009	南京银行	39,779,316.25	3.63
41	000069	华侨城 A	38,461,287.34	3.51
42	002202	金风科技	37,118,736.77	3.39
43	300002	神州泰岳	36,296,558.03	3.31
44	600031	三一重工	35,511,815.39	3.24
45	000002	万科A	35,345,865.94	3.22
46	600366	宁波韵升	34,362,028.67	3.13
47	600893	航空动力	32,911,788.37	3.00
48	600153	建发股份	32,458,114.89	2.96
49	600467	好当家	31,699,712.01	2.89
50	000559	万向钱潮	29,288,719.05	2.67
51	002214	大立科技	27,807,894.93	2.54
52	000869	张 裕 A	27,334,542.81	2.49
53	000630	铜陵有色	26,254,685.67	2.40
54	000063	中兴通讯	25,877,429.04	2.36
55	601168	西部矿业	25,791,011.17	2.35
56	000898	鞍钢股份	24,673,718.54	2.25
57	600581	八一钢铁	24,494,218.03	2.23
58	600594	益佰制药	24,108,952.50	2.20
59	002304	洋河股份	24,071,222.35	2.20
60	002001	新和成	24,019,542.90	2.19
61	002230	科大讯飞	22,999,598.76	2.10
62	600216	浙江医药	22,588,780.19	2.06
63	600707	彩虹股份	22,240,152.40	2.03
64 注: 实	601668	中国建筑	22,060,181.00	2.01

5日112399	X人 妣父 尼額		4,690,818,155.38
	注:	和 窦出股票收入总额"均按买卖成交金额(或交单价乘以成交 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	49,249,052.80	3.51
2	央行票据	168,450,000.00	12.00
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	66,091,083.52	4.71
-	th/sh		

14134247601184611	MOREOUS OF BASICISTS STORES	H 2 H 1 T T T T H H 1 2 T T T T T T T T T T T T T T T T T T		金额单位:人民币元
债券代码	债券名称	数量 胀)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
0801062	08央行票据 62	1,000,000	100,480,000.00	7.16
1001072	10央行票据 72	700,000	67,970,000.00	4.84
125709	唐钢转债	448,061	49,071,640.72	3.50
010110	21国债(00)	340,000	34,217,600.00	2.44
010112	21国债(12)	149,240	15,031,452.80	1.07
	债券代码 0801062 1001072 125709 010110 010112	债券代码 债券名称 0801062 08央行票据 62 1001072 10央行票据 72 125709 唐销券债 010110 21国债00 010112 21国债02	债券代码 债券名称 数量 低) 0801062 08央行票据 62 1,000,000 1001072 10央行票据 72 700,000 125709 唐销铸债 448,061 010110 21国债的 340,000 010112 21国债的 149,240	0801062

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,285,991.48
2	应收证券清算款	14,841,343.91
3	应收股利	-
4	应收利息	3,655,184.26
5	应收申购款	672,791.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,455,310.87

				777104-L-DT-1\check(1)\check(1
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	125709	唐钢转债	49,071,640.72	3.50
2	113001	中行转债	10,986,000.00	0.78
3	110003	新钢转债	6,033,442.80	0.43
		字在流通受限情况的说明 名股票中不存在流通受限的情况。		

89 基金份额持有人信息

	户均持有的基金份	持有人结构					
持有人户数(户)		机构投资者		个人投资者			
	額	持有份额	占总份额比 例		持有份額	占总份额比例	
16,352	72,870.40	531,585,615.86	44.61%		659,991,222.95	55.39%	
9.2 期末基金管	管理人的从业人员持有	「本开放式基金的情况				•	
Ŋ	ĬΕ	持有份额总数	(份)		占据金总统	}額比例	
基金管理公司所有 放式基金	T从业人员持有本开		1,185,22	27.07		0.10%	
	,	§10 开放式	基金份额变动			单位:	
世人人同正祝日 /	2000 Œ 4 E 27 E 31	e A (r) der Moder				2 (72 070 405 7	

基金合同生效日(2009年4月27日)基金份額总額	2,672,979,485.72
本报告期期初基金份额总额	950,084,328.65
本报告期基金总申购份額	2,411,212,838.50
减:本报告期基金总赎回份额	2,169,720,328.34
本报告期期末基金份额总额	1,191,576,838.81
注:本期申购中包含转入份额,本期赎回中包含转出份额。	
11.1 基金份额持有人大会决议	

11.2 第五日注入、第五九日八四十二第五九日四二四里入八手文句
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,魏琰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》、《仁海证券报》、《征券时报》及公司网络
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窗任的公告,经本公司董事会批准,石松庵先生不再担任本基金管理
11.2.1.2.2.011 + 2万1 自,平盛金音连入及中天了公司副总经建筑区的公司,完于宋公司量中安北征,司公园完于广州自己广平盛金音号 人公司副总经理职务。该变更事项已向相关监管部门各案,并于2011 年 2 月 1 日在 中国证券报》、任海证券报》、征券时报》及公司院
为公司的企业中的。例文文中央公司和人监督的自治案,并引起了一个工程,由企业的监狱的,是一个工程, 的进行了披露。
11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本报告期内经中国证监会批准,晏秋生任本基金托管人中国工商银行资产托管部副总经理。
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
大担生期由 工证基金公约期 L 业本财本 业本任务业务的运送

1增與尼力本基金建建提供了2年的擴張。 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 本报告期中,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研工的有关情况 11.71基金租用证券公司交易研工的保护投资及佣金交付情况

	交易 単元 数量	权采父芴		应又包以弃间的用金		1
券商名称		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	备注
国海证券有限责任公司	2	2,441,895,068.67	25.87%	2,006,791.95	25.46%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,905,474,289.51	20.19%	1,548,212.69	19.64%	-
西部证券股份有限公司	1	1,066,261,724.36	11.30%	906,314.82	11.50%	新增一个交易单元
厦门证券有限公司	1	1,061,471,983.54	11.25%	902,243.71	11.45%	-
中信证券股份有限公司	1	674,838,630.92	7.15%	573,606.34	7.28%	-
长城证券有限责任公司	1	578,643,577.88	6.13%	491,844.06	6.24%	-
信达证券股份有限公司	1	512,911,516.19	5.43%	435,973.41	5.53%	新增一个交易单元
爱建证券有限责任公司	1	428,474,347.29	4.54%	364,202.93	4.62%	新增一个交易单元
国泰君安证券股份有限公司	1	313,367,410.33	3.32%	266,361.21	3.38%	-
国信证券股份有限公司	1	276,885,187.44	2.93%	235,352.91	2.99%	-
德邦证券有限责任公司	1	92,795,521.25	0.98%	78,876.91	1.00%	新增一个交易单元
英大证券有限责任公司	1	86,214,684.52	0.91%	73,282.82	0.93%	新增一个交易单元
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增一个交易单元
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	新增一个交易单元

		金额单位:人民币元		
	债券交易			
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的比例		
国海证券有限责任公司	39,067,137.45	5.83%		
兴业证券股份有限公司	38,184,066.75	5.69%		
西部证券股份有限公司	36,687,397.30	5.47%		
厦门证券有限公司	382,876,466.10	57.10%		
中信证券股份有限公司	-	-		
长城证券有限责任公司	39,186,145.20	5.84%		
信达证券股份有限公司	84,021,429.70	12.53%		
爱建证券有限责任公司	39,472,374.30	5.89%		
国泰君安证券股份有限公司	-	-		
国信证券股份有限公司	-	-		
德邦证券有限责任公司	11,100,000.00	1.66%		
英大证券有限责任公司	-	-		
招商证券股份有限公司	-	-		
文鱼证券右阻从司	_	_		