银华沪深300指数证券投资基金（LOF）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	495,740,616.48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年10月30日

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。 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10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日
本期已实现收益	-4,881,124.48	2,527,549.83
本期利润	-64,541,268.79	43,189,093.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1089	0.0753
本期加权平均净值利润率	-11.61%	7.18%
本期基金份额净值增长率	-11.85%	8.00%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配利润	-23,742,079.34	2,575,937.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0479	0.0044
期末基金资产净值	471,998,537.14	627,312,361.40
期末基金份额净值	0.952	1.080
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	-4.80%	8.00%

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：上市基金交易佣金、开放式基金申购、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
过去三个月	6.01%	1.67%	6.28%	1.68%	-0.27%	-0.01%
过去六个月	20.66%	1.47%	20.94%	1.47%	-0.28%	0.00%
过去一年	-11.85%	1.50%	-11.78%	1.50%	-0.07%	0.00%
自基金运作日至今	-4.80%	1.47%	-1.89%	1.52%	-2.91%	-0.05%

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%。

3.2.3 自基金合同生效以来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

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

本基金于2010年以及2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止期间未进行基金利润分配。

§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）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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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。历任美国普尔永道金融服务部经理，巴克莱银行量化分析部副总裁，巴克莱资本有限公司副董事。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。
路志刚先生	本基金的基金经理。	2009年10月14日	2010年9月20日	13年	金融学博士。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，并自2009年6月8日起至2010年9月20日任银华-道琼斯88精选证券投资基金基金经理，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

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

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，A股市场在中国经济结构调整和货币政策紧缩的预期下，产生了一定幅度的调整。分时间去看，下跌时间大约5个月，上涨时间大约3个月，跌多涨少。分空间去看，下跌强度强于上涨强度，短期震荡向下。年初以来，对经济二次探底的担忧、频出的房地产紧缩政策、地方融资平台的风险、落后产能的淘汰，均抑制了二级市场的走势。中长期来看，随着中国经济转型的逐步推进，推动中国经济长期快速发展的基本要素仍然存在，所以我们依然坚定看好中国A股市场的长期发展前景，并对未来A股市场的长期表现充满信心。

我们通过自行开发的量化投资管理系统，在发生申购赎回、停牌、配股、增发、分红、成分股调整等事件时对投资组合进行必要的调整，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。在大额申购赎回发生时，及时调整基金的股票仓位，有效防止其对跟踪误差造成的冲击。

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0.952元，本报告期份额净值增长率为-11.85%，同期业绩比较基准增长率为-11.78%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.04%，年化跟踪误差为0.65%，符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%以及年化跟踪误差不超过4%的限制。

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年从经济层面来看，通胀上行与政策调控的矛盾决定了投资的仓位；从市场层面来看，蓝筹股与中小盘股票估值分化的矛盾决定了行业配置；因此我们一方面需要密切关注通胀相关的经济数据（信贷投放、粮食及国际大宗商品价格、外围经济体复苏等），另一方面需要关注投资者对估值分化板块的情绪变化。

从CPI的翘尾因素来看，全年通胀将呈现前高后低的状态，上半年通胀预计在3%以上，宏观经济总体呈现弱复苏、高通胀的"类滞胀"状态。经济和政策的不确定性，难以对全市场形成趋势性支持，更大概率迎来行业阶段性行情，可重点关注低估值和高业绩增速的蓝筹股。

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：银华沪深300指数证券投资基金（LOF）

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	25,898,717.56	44,055,963.78
结算备付金	396,802.16	4,881,838.63
存出保证金	21,147.24	-
交易性金融资产	443,184,220.68	579,819,367.68
其中：股票投资	443,184,220.68	579,819,367.68
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	7,661.92	13,355.72
应收股利	-	-
应收申购款	732,727.45	3,642,606.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	472,697,719.11	632,413,132.17
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	-	-
应付赎回款	32,580.39	3,609,131.69
应付管理人报酬	218,813.84	252,398.90
应付托管费	65,644.18	75,719.65
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	332,051.40	1,109,918.43
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,092.16	53,602.10
负债合计	699,181.97	5,100,770.77
所有者权益：		
实收基金	495,740,616.48	580,639,981.57
未分配利润	-23,742,079.34	46,672,379.83
所有者权益合计	471,998,537.14	627,312,361.40
负债和所有者权益总计	472,697,719.11	632,413,132.17

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值为人民币0.952元，基金份额总额为495,740,616.48份。

7.2 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：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10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日
一、收入	-59,053,885.31	45,929,347.08
1.利息收入	283,151.84	292,320.95
其中：存款利息收入	283,151.84	292,320.95
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）	-471,909.16	4,536,292.80
其中：股票投资收益	-6,316,682.44	4,531,605.33
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	5,844,773.28	4,687.47
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-59,660,144.31	40,661,544.10
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	795,016.32	439,189.23
二、费用	5,487,383.48	2,740,253.15
1.管理人报酬	2,778,347.06	642,516.17
2.托管费	833,504.15	192,754.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,442,569.08	1,755,778.34
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	432,963.19	149,203.77
三、利润总额	-64,541,268.79	43,189,093.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-64,541,268.79	43,189,093.93

7.3 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：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）	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）	-	-64,541,268.79	-64,541,268.79
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）	-84,899,365.09	-5,873,190.38	-90,772,555.47
其中：1.基金申购款	592,460,094.24	-17,748,712.63	574,711,381.61
2.基金赎回款	-677,359,459.33	11,875,522.25	-665,483,937.08
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）	495,740,616.48	-23,742,079.34	471,998,537.14
项目	上年度可比期间 2009年10月14日（基金合同生效日）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）	670,189,105.75	-	670,189,105.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,189,093.93	43,189,093.93
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）	-89,549,124.18	3,483,285.90	-86,065,838.28
其中：1.基金申购款	248,368,686.66	16,864,353.35	265,233,040.01
2.基金赎回款	-337,917,810.84	-13,381,067.45	-351,298,878.29
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）	580,639,981.57	46,672,379.83	627,312,361.40

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

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）（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"）证监许可［2009］793号文《关于核准银华沪深300指数证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由银华基金管理有限公司依照《基金法》、基金合同及其他有关规定于2009年9月4日至2009年9月30日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2009）验字第60468687_A03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2009年10月14日生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币669,901,627.47元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币287,478.28元，以上实收基金（本息）合计为人民币670,189,105.75元，折合670,189,105.75份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、现金和到期日在一年以内的政府债券等。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%。在保证流动性的前提下，如果法律法规允许，在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准选定为：95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

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

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不涉及差错更正事项。

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，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	上年度可比期间 2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东北证券	-	-	167,320,208.80	12.71

注：本基金2010年度未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金2010年度及2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3债券回购交易

本基金2010年度及2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金2010年度及2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2009年10月14日（基金合同生效日）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（%）
东北证券	135,949.05	12.25	135,949.05	12.25

注：（1）本基金自2010年度无应支付给关联方的佣金。

（2）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）。

（3）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10月14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	2,778,347.06	642,516.17
其中：支付给销售机构的客户维护费	726,974.85	143,896.21

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。

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10月14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托管费	833,504.15	192,754.87

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。

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2010年度及2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间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10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	25,898,717.56	268,364.69	44,055,963.78	271,905.88

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	14,888	239,399.04

注：本基金于2009年10月14日（基金合同生效日）至2009年12月31日止会计期间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

本基金本期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.9.2 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
600518	康美药业	2010-12-28	配股临时停牌	19.71	2011-1-6	17.29	108,027	1,554,275.93	2,129,212.17	-
600816	安信信托	2010-6-2	重大事项	13.60	未公告	未知	37,677	624,738.48	512,407.20	-
600664	哈药股份	2010-12-29	重大事项	22.57	2011-2-16	24.83	64,755	1,264,594.94	1,461,520.35	-
000059	辽通化工	2010-12-2	重大事项	11.59	未公告	未知	55,068	590,067.18	638,238.12	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大事项	7.78	未公告	未知	94,815	764,551.57	737,660.70	-
000959	首钢股份	2010-10-29	重大事项	4.42	未公告	未知	119,296	574,833.57	527,288.32	-

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，本基金无需要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	443,184,220.68	93.76
	其中：股票	443,184,220.68	93.76
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	26,295,519.72	5.56
6	其他各项资产	3,217,978.71	0.68
7	合计	472,697,719.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	1,983,022.14	0.42
B	采掘业	55,055,154.88	11.66
C	制造业	152,679,370.27	32.35
C0	食品、饮料	23,495,951.25	4.98
C1	纺织、服装、皮毛	1,544,601.24	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	524,550.94	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,101,338.47	2.35
C5	电子	2,142,494.87	0.45
C6	金属、非金属	40,690,570.71	8.62
C7	机械、设备、仪表	54,153,114.52	11.47
C8	医药、生物制品	17,340,804.33	3.67
C99	其他制造业	1,685,943.94	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,375,825.50	3.05
E	建筑业	13,943,243.11	2.95
F	交通运输、仓储业	20,232,256.54	4.29
G	信息技术业	14,005,571.87	2.97
H	批发和零售贸易	13,596,234.57	2.88
I	金融、保险业	116,366,216.36	24.65
J	房地产业	22,987,568.97	4.87
K	社会服务业	4,011,259.04	0.85
L	传播与文化产业	776,067.38	0.16
M	综合类	10,304,267.45	2.18
	合计	440,316,058.08	93.29

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	31,110.00	0.01
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	31,110.00	0.01
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	2,837,052.60	0.60
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,868,162.60	0.61

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	279,895	15,718,903.20	3.33
2	600036	招商银行	1,035,691	13,267,201.71	2.81
3	601328	交通银行	1,736,621	9,516,683.08	2.02
4	600016	民生银行	1,895,511	9,515,465.22	2.02
5	601398	工商银行	2,158,304	9,151,208.96	1.94
6	601166	兴业银行	350,893	8,438,976.65	1.79
7	600000	浦发银行	599,357	7,426,033.23	1.57
8	600030	中信证券	578,700	7,285,833.00	1.54
9	601088	中国神华	275,222	6,800,735.62	1.44
10	000002	万 科A	814,984	6,699,168.48	1.42

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	601288	农业银行	867,405	2,324,645.40	0.49
2	600816	安信信托	37,677	512,407.20	0.11
3	601126	四方股份	1,000	31,110.00	0.01

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	601318	中国平安	12,714,958.83	2.03
2	600036	招商银行	11,397,061.72	1.82
3	601328	交通银行	9,108,496.94	1.45
4	601166	兴业银行	8,680,014.90	1.38
5	601398	工商银行	7,846,523.10	1.25
6	600016	民生银行	7,489,401.79	1.19
7	601668	中国建筑	6,882,130.00	1.10
8	601899	紫金矿业	6,762,896.60	1.08
9	600000	浦发银行	6,387,718.44	1.02
10	000002	万 科A	5,815,074.91	0.93
11	601088	中国神华	5,725,255.21	0.91
12	600030	中信证券	5,671,062.53	0.90
13	600519	贵州茅台	4,732,322.31	0.75
14	000858	五 粮 液	4,557,565.45	0.73
15	601006	大秦铁路	4,474,300.35	0.71
16	601601	中国太保	4,355,568.42	0.69
17	601169	北京银行	4,138,886.19	0.66
18	002024	苏宁电器	3,989,146.47	0.64
19	600104	上海汽车	3,881,109.56	0.62
20	601288	农业银行	3,799,312.00	0.61

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	601318	中国平安	14,260,377.64	2.27
2	600036	招商银行	13,984,854.50	2.23
3	601328	交通银行	10,486,464.49	1.67
4	600016	民生银行	10,035,138.24	1.60
5	601398	工商银行	9,888,881.08	1.58
6	601166	兴业银行	9,699,725.47	1.55
7	600000	浦发银行	8,026,995.19	1.28
8	600030	中信证券	7,804,081.96	1.24
9	000002	万 科A	7,695,783.32	1.23
10	601088	中国神华	7,633,074.29	1.22
11	600519	贵州茅台	6,100,004.27	0.97
12	601601	中国太保	6,017,217.99	0.96
13	000858	五 粮 液	6,010,938.93	0.96
14	601169	北京银行	5,243,291.17	0.84
15	000001	深发展A	5,004,980.73	0.80
16	002024	苏宁电器	4,996,884.36	0.80
17	600104	上海汽车	4,709,601.99	0.75
18	601899	紫金矿业	4,286,629.83	0.68
19	600837	海通证券	4,210,105.70	0.67
20	600900	长江电力	4,189,085.72	0.67

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	426,609,503.87
卖出股票收入（成交）总额	496,347,844.21

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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	21,147.24
2	应收证券清算款	2,456,442.10
3	应收股利	-
4	应收利息	7,661.92
5	应收申购款	732,727.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,217,978.71

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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	600816	安信信托	512,407.20	0.11	重大事项

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，各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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
16,595	29,872.89	33,635,691.24	6.78%	462,104,925.24	93.22%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴晶蓉	6,529,239.00	30.56%
2	郭素勤	576,000.00	2.70%
3	张元中	331,400.00	1.55%
4	黄国序	300,000.00	1.40%
5	余红旗	300,000.00	1.40%
6	郭晓宇	246,033.00	1.15%
7	杨玲娣	234,838.00	1.10%
8	俞霞	231,900.00	1.09%
9	王碧玲	207,504.00	0.97%
10	李磊	206,200.00	0.97%

9.3 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	47,097.99	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年10月14日）基金份额总额	670,189,105.75
本报告期期初基金份额总额	580,639,981.57
本报告期基金总申购份额	592,460,094.24
减：本报告期基金总赎回份额	677,359,459.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	495,740,616.48

§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

本报告期由安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内本基金应支付给安永华明会计师事务所的报酬共计人民币50,000.00元。目前的审计机构已连续为本基金提供2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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
兴业证券股份有限公司	3	181,960,576.55	19.87%	149,506.86	19.43%	新增1个交易单元
西部证券股份有限公司	1	176,396,415.32	19.26%	149,939.47	19.48%	新增1个交易单元
中国民族证券有限责任公司	1	93,976,986.85	10.26%	79,880.78	10.38%	-
上海证券有限责任公司	1	92,949,280.72	10.15%	79,007.10	10.27%	-
国金证券股份有限公司	2	73,000,390.06	7.97%	62,051.02	8.06%	-
广发证券股份有限公司	1	47,725,777.46	5.21%	40,567.25	5.27%	-
德邦证券有限责任公司	1	41,319,098.19	4.51%	35,121.10	4.56%	-
华泰联合证券有限责任公司	2	33,449,564.70	3.65%	28,052.56	3.64%	-
长城证券有限责任公司	2	26,112,924.34	2.85%	21,217.03	2.76%	-
长江证券股份有限公司	2	25,011,993.75	2.73%	21,260.16	2.76%	-
山西证券有限责任公司	1	22,286,788.00	2.43%	18,943.63	2.46%	-
光大证券股份有限公司	2	20,870,219.13	2.28%	16,957.20	2.20%	-
中国国际金融有限公司	2	20,490,414.54	2.24%	16,721.35	2.17%	-
渤海证券股份有限公司	1	11,504,925.63	1.26%	9,779.43	1.27%	-
中信证券股份有限公司	3	10,602,324.11	1.16%	8,614.39	1.12%	新增1个交易单元
东方证券股份有限公司	2	10,126,437.84	1.11%	8,607.54	1.12%	新增2个交易单元
中银国际证券有限责任公司	3	8,548,021.61	0.93%	6,945.41	0.90%	新增1个交易单元
安信证券股份有限公司	3	7,223,312.55	0.79%	6,139.90	0.80%	-
北京高华证券有限责任公司	1	7,046,124.06	0.77%	5,989.18	0.78%	-
宏源证券股份有限公司	2	3,862,010.01	0.42%	3,137.93	0.41%	新增1个交易单元
首创证券有限责任公司	2	1,459,581.77	0.16%	1,185.95	0.15%	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增1个交易单元
方正证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内未通过交易单元进行债券回购交易。

2、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。

3、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。

§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