银华内需精选股票型证券投资基金（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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	银华内需精选股票(LOF)
基金主代码	161810
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年7月1日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,876,523,185.52 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16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过重点投资于内需增长背景下具有持续竞争力的优势企业,在控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,重点投资内需增长背景下具有持续竞争力的优势企业,力求实现基金资产的长期稳定增值。 本基金的投资组合比例范围为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券基金与货币市场基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高预期收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	李芳菲
	联系电话	(010)58163000	010-63201510
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	Lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95599
传真		(010)58163027	010-63201816

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7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日
本期已实现收益	190,144,812.53	-13,484,795.64
本期利润	75,076,455.09	348,046,822.14
加权平均基金份额本期利润	0.0281	0.0718
本期加权平均净值利润率	2.78%	7.31%
本期基金份额净值增长率	5.96%	9.53%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	158,389,603.56	-119,714,993.88
期末可供分配基金份额利润	0.0551	-0.0342
期末基金资产净值	3,271,199,186.35	3,760,516,074.85
期末基金份额净值	1.137	1.073
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	16.06%	9.53%

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,为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述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	16.02%	2.03%	5.31%	1.42%	10.71%	0.61%
过去六个月	34.56%	1.72%	17.68%	1.24%	16.88%	0.48%
过去一年	5.96%	1.58%	-9.12%	1.26%	15.08%	0.32%
自基金合同生效日起至今	16.06%	1.49%	0.80%	1.43%	15.26%	0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

由于本基金投资于股票等权益类资产占基金资产比例为60%-95%,在实际投资运作中,其中间值80%为本基金在均衡市场情况下的股票投资比例,在此基础上本基金再根据不同市场情况下各项大类资产的预期风险和收益水平对该比例进行动态调整,故本基金采取80%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重,相应将20%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

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,股票投资占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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

2010年度及2009年7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日止会计期间本基金未进行利润分配。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐子涵先生	本基金的基金经理。	2010年6月21日	-	9年	金融学硕士。毕业于清华大学、英国帝国理工大学;9年证券从业经验。曾就职于英国保诚集团M&G基金管理(国际)公司,任商业拓展分析师;曾就职于海富通基金管理有限公司,历任交易员、股票分析师、海富通股票证券投资基金基金经理助理、海富通强化回报混合证券投资基金基金经理助理以及海富通风格优势股票型证券投资基金基金经理助理。2010年1月加盟银华基金管理有限公司。具有从业资格。国籍:中国。
齐海滔先生	本基金的基金经理。	2009年7月1日	2010年12月27日	6年	硕士学位。曾在长城证券有限责任公司从事行业研究和投资管理工作。2006年6月加盟银华基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职。2009年3月2日至2009年6月30日担任天华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》及其各项实施准则、《银华内需精选股票型证券投资基金(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。本基金无违法、违规行为。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是起伏跌宕的一年。在国家对地产越来越严厉的打压下,以地产和银行为代表的大盘蓝筹股尽管估值较低,全年并没有太好的表现;而另一方面,以节能减排、新能源,TMT(科技、媒体和通信)以及新技术为代表的新兴行业以及大消费类行业等,受益于经济增长模式的转变和国家不断推出的政策红利,演绎出一轮波澜壮阔的牛市行情。中小市值股票表现明显优于大市值股票。

回顾我们2010年的表现,我们对自己能够坚持住新兴产业的投资主线感到满意。我们的确抓住了九月底的周期股行情和十月中旬成长股的崛起,因此能够大幅超上和超越我们的业绩比较基准,但我们在对我国经济发展阶段认识不足的问题,如果不是在六月底的市场调整中因为熬不住而降低新兴产业的仓位,如果能够在十月初的周期类反弹中能够坚持得更久一些,我们的表现应该会更好。

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1.137元,本报告期份额净值增长率为5.96%,同期业绩比较基准收益率为-9.12%。

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2011年,我们理解到,通货膨胀的大的趋势已经形成,全球范围的大宗商品牛市可能会延续,以有色、橡胶、钾肥、磷肥为代表的资源品和以种子为代表的农业或者可以纵横时间更久一些;我们认识到,未来战略新兴产业的子行业的热点轮换可能较2010年更为复杂,需要对未来发展更为深邃的思考,对子行业更广泛的覆盖和更加充分的调研;我们觉悟到,以汽车、家电等为代表的低估值行业的增长势头良好,应该存在着估值修复的机会;我们同时意识到,也许是时候重新审视以军工、高铁等为代表的高端机械制造行业的逻辑了。

未来的路可能会很曲折,但是我们并不悲观,相信在充分调整和修正后,代表新的生产力方向的产业会更加充满活力。

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

在托管银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)托管协议》的约定,对银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)管理人—银华基金管理有限公司2010年1月1日至2010年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,银华基金管理有限公司在银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,银华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:银华内需精选股票型证券投资基金

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	443,360,105.93	407,373,065.23
结算备付金	11,680,837.47	2,851,216.61
存出保证金	4,204,914.68	1,668,245.44
交易性金融资产	2,818,849,409.77	3,366,717,789.76
其中:股票投资	2,818,849,409.77	3,316,223,679.36
基金投资	-	-
债券投资	-	50,494,110.40
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	-	45,190,084.95
应收利息	58,753.22	820,503.68
应收股利	-	-
应收申购款	9,885,900.63	2,139,968.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,288,039,921.70	3,826,760,874.05
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	4,385,519.36	56,370,656.17
应付管理人报酬	3,914,119.55	4,987,667.21
应付托管费	652,353.26	831,277.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,662,804.62	2,644,524.44
应交税费	858,221.21	858,221.21
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	367,717.35	552,452.31
负债合计	16,840,735.35	66,244,799.20
所有者权益:		
实收基金	2,928,541,601.70	3,567,747,103.93
未分配利润	342,657,584.65	192,768,970.92
所有者权益合计	3,271,199,186.35	3,760,516,074.85
负债和所有者权益总计	3,288,039,921.70	3,826,760,874.05

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值为人民币1.1370元,基金份额总额为2,876,523,185.52份。

7.2 利润表

会计主体:银华内需精选股票型证券投资基金

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7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日
一、收入	160,292,746.67	399,363,982.00
1.利息收入	4,310,011.98	10,805,417.66
其中:存款利息收入	2,684,070.47	6,905,041.58
债券利息收入	1,625,941.51	3,900,376.08
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)	268,139,129.44	22,657,079.70
其中:股票投资收益	255,333,534.90	22,543,624.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,098,485.65	-1,284,523.01
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,707,108.89	1,397,978.46
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-115,068,357.44	361,531,617.78
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,911,962.69	4,369,866.86
减:二、费用	85,216,291.58	51,317,159.86
1.管理人报酬	40,495,918.35	36,673,804.98
2.托管费	6,749,319.60	6,112,300.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	37,465,857.08	8,261,757.14
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	505,196.55	269,296.91
三、利润总额	75,076,455.09	348,046,822.14
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	75,076,455.09	348,046,822.14

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华内需精选股票型证券投资基金

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)	3,567,747,103.93	192,768,970.92	3,760,516,074.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,076,455.09	75,076,455.09
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)	-639,205,502.23	74,812,158.64	-564,393,343.59
其中:1.基金申购款	2,046,552,607.66	228,626,276.42	2,275,178,884.08
2.基金赎回款	-2,685,758,109.89	-153,814,117.78	-2,839,572,227.67
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)	2,928,541,601.70	342,657,584.65	3,271,199,186.35

项目	上年度可比期间 2009年7月1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)	2,500,000,000.00	-171,451,107.36	2,328,548,892.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	348,046,822.14	348,046,822.14
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)	1,067,747,103.93	16,173,256.14	1,083,920,360.07
其中:1.基金申购款	4,575,935,666.95	3,876,089.75	4,579,811,756.70
2.基金赎回款	-3,508,188,563.02	12,297,166.39	-3,495,891,396.63
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)	3,567,747,103.93	192,768,970.92	3,760,516,074.85

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

银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")由天华证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2009年6月18日证监许可[2009]530号文《关于核准天华证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》,天华证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金,调整存续期限,终止上市交易,调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,并更名为"银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)"。自2009年7月1日起,《银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,原《天华证券投资基金基金合同》失效。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《关于原天华证券投资基金基金份额折算结果的公告》的相关规定,基金管理人于2009年8月6日,即本基金集中申购验资完成日对投资者持有的原天华证券投资基金(以下简称"原基金天华")进行了基金份额折算,折算基准日为2009年8月5日。基金份额折算基准日折算前基金资产净值人民币2,376,874,407.99元,原基金天华的基金份额按照1:0.950749763的折算比例进行折算,折算后基金份额净值为人民币1.000元,折算后的基金份额总额为2,376,874,407份。基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提出基金份额的变更登记申请,中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司已于2009年8月6日进行了基金份额的变更登记。

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例范围为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

本基金本年度无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本年度无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本年度无需要说明的会计差错更正事项。

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、国家税务总局财税字[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
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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 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7月1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(%)
西南证券	317,652,864.02	1.30	-	-
第一创业	1,786,038,199.86	7.30	-	-
东北证券	793,427,987.18	3.24	-	-

注:本基金自2009年7月1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股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金于2010年度及上年度可比期间均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

本基金于2010年度及上年度可比期间均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

本基金于2010年度及上年度可比期间均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	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	258,095.89	1.27	-	-
第一创业	1,518,131.31	7.45	516,871.70	7.76
东北证券	674,404.64	3.31	556,060.43	8.35

注:(1)本基金自2009年7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日止会计期间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7月1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	40,495,918.35	36,673,804.98
其中:支付给销售机构的客户维护费	10,521,923.11	5,619,866.10

注:基金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7月1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	6,749,319.60	6,112,300.83

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2010年度及2009年7月1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

份额单位:份

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7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日
基金合同生效日(2009年7月1日)持有的基金份额	-	57,287,789.00
期初持有的基金份额	54,466,352.00	-
期间申购总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-2,821,437.00
减:期间赎回总份额	-	-
期末持有的基金份额	54,466,352.00	54,466,352.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.89%	1.55%

注:根据《银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的相关规定,基金管理人已于2009年8月6日,即本基金集中申购验资完成日对投资者持有的原基金天华进行了基金份额折算。经基金管理人计算并经基金托管人中国农业银行确认,原基金天华的基金份额按照1:0.950749763的折算比例进行折算,基金管理人持有原基金天华57,287,789.00份,折算后54,466,352.00份。基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2010年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2009年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西南证券	-	-	2,376,874.00	0.07

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于2010年末未持有本基金份额。

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7月1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
中国农业银行	443,360,105.93	2,545,610.72	407,373,065.23	6,860,965.36

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2010年度及2009年7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日止会计期间均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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

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
600991	广汽长丰	2010-10-28	重大资产重组	14.07	2011年3月23日	15.00	4,000,000	37,552,573.26	56,280,000.00	-
300113	顺网科技	2010-12-13	重大资产重组	69.40	2011年1月31日	75.98	453,733	30,413,278.72	31,489,070.20	-

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	2,818,849,409.77	85.73
	其中:股票	2,818,849,409.77	85.73
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	455,040,943.40	13.84
6	其他各项资产	14,149,568.53	0.43
7	合计	3,288,039,921.70	100.00

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	160,212,848.69	4.90
B	采掘业	57,913,787.80	1.77
C	制造业	1,924,670,877.45	58.84
C0	食品、饮料	115,220,403.78	3.52
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	288,091,730.49	8.81
C5	电子	101,547,945.10	3.10
C6	金属、非金属	325,391,674.76	9.95
C7	机械、设备、仪表	1,020,135,654.52	31.19
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	74,283,468.80	2.27
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	64,246,199.06	1.96
G	信息技术业	296,289,032.32	9.06
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	286,186,664.45	8.75
L	传播与文化产业	29,330,000.00	0.90
M	综合类	-	-
	合计	2,818,849,409.77	86.17

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

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	600570	恒生电子	8,000,000	162,000,000.00	4.95
2	300024	机器人	2,210,158	127,680,827.66	3.90
3	000012	南 玻A	5,500,000	108,625,000.00	3.32
4	000598	兴蓉投资	5,206,579	107,411,724.77	3.28
5	300055	万邦达	657,781	88,997,769.30	2.72
6	600703	三安光电	1,700,000	77,962,000.00	2.38
7	000792	盐湖钾肥	1,068,944	70,806,850.56	2.16
8	300002	神州泰岳	1,250,300	69,879,267.00	2.14
9	002407	多氟多	899,713	69,718,760.37	2.13
10	000630	铜陵有色	1,944,791	68,164,924.55	2.08

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	601601	中国太保	192,851,820.86	5.13
2	600036	招商银行	181,193,700.52	4.82
3	600031	三一重工	180,588,040.94	4.80
4	601318	中国平安	171,502,945.28	4.56
5	600570	恒生电子	138,671,233.75	3.69
6	600523	贵航股份	136,865,769.80	3.64
7	601111	中国国航	135,690,343.00	3.61
8	600000	浦发银行	134,427,720.86	3.57
9	600362	江西铜业	125,884,666.72	3.35
10	601699	潞安环能	117,838,535.54	3.13
11	000002	万 科A	117,029,103.96	3.11
12	000519	江南红箭	116,858,039.10	3.11
13	000762	西藏矿业	112,773,180.95	3.00
14	600100	同方股份	109,970,759.59	2.92
15	601166	兴业银行	109,380,549.52	2.91
16	300002	神州泰岳	106,504,285.27	2.83
17	600019	宝钢股份	106,362,089.39	2.83
18	300048	合康变频	102,304,193.52	2.72
19	300024	机器人	96,141,342.26	2.56
20	601628	中国人寿	96,003,447.41	2.55
21	000050	深天马A	95,913,847.20	2.55
22	000598	兴蓉投资	94,488,486.32	2.51
23	600303	曙光股份	94,406,270.11	2.51
24	600479	千金药业	91,617,669.81	2.44
25	000001	深发展A	90,695,125.87	2.41
26	000630	铜陵有色	90,569,809.18	2.41
27	601939	建设银行	87,063,432.40	2.32
28	600673	东阳光铝	85,819,369.73	2.28
29	002230	科大讯飞	82,788,631.69	2.20
30	601169	北京银行	82,426,334.04	2.19
31	000157	中联重科	82,162,490.83	2.18
32	600366	宁波韵升	82,001,372.84	2.18
33	000937	冀中能源	80,442,574.48	2.14
34	000826	桑德环境	79,711,608.79	2.12
35	002146	荣盛发展	79,308,844.29	2.11
36	600079	人福医药	79,105,334.24	2.10
37	002041	登海种业	78,759,794.92	2.09
38	000997	新 大 陆	78,015,833.58	2.07
39	000969	安泰科技	76,463,171.86	2.03
40	002241	歌尔声学	76,406,709.05	2.03
41	002028	思源电气	75,681,964.45	2.01
42	600991	广汽长丰	75,210,611.04	2.00

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	269,599,177.11	7.17
2	600031	三一重工	235,722,767.92	6.27
3	600348	国阳新能	207,826,211.99	5.53
4	601601	中国太保	186,343,924.77	4.96
5	600036	招商银行	182,064,117.65	4.84
6	600104	上海汽车	168,753,142.08	4.49
7	600660	福耀玻璃	167,420,666.15	4.45
8	601166	兴业银行	165,911,276.42	4.41
9	601699	潞安环能	150,329,094.30	4.00
10	000858	五 粮 液	147,316,697.72	3.92
11	601111	中国国航	139,624,503.01	3.71
12	000983	西山煤电	137,439,860.62	3.65
13	600000	浦发银行	129,339,455.83	3.44
14	000002	万 科A	117,778,269.33	3.13
15	600100	同方股份	115,487,571.91	3.07
16	000527	美的电器	114,805,166.14	3.05
17	000425	徐工机械	113,250,955.39	3.01
18	002230	科大讯飞	106,930,420.98	2.84
19	600019	宝钢股份	101,019,855.55	2.69
20	601628	中国人寿	96,033,910.47	2.55
21	601169	北京银行	95,952,521.48	2.55
22	000937	冀中能源	95,614,632.68	2.54
23	000960	锡业股份	95,492,686.83	2.54
24	000050	深天马A	93,895,722.91	2.50
25	600303	曙光股份	93,757,022.76	2.49
26	000069	华侨城A	92,254,119.43	2.45
27	000001	深发展A	90,994,737.79	2.42
28	600352	浙江龙盛	90,702,438.71	2.41
29	601939	建设银行	88,415,816.36	2.35
30	600546	山煤国际	87,659,460.20	2.33
31	000538	云南白药	87,522,556.07	2.33
32	002241	歌尔声学	84,899,681.06	2.26
33	000400	许继电气	84,731,541.69	2.25
34	600486	扬农化工	83,429,865.65	2.22
35	600523	贵航股份	83,217,726.95	2.21
36	000898	鞍钢股份	83,034,403.37	2.21
37	600479	千金药业	82,476,610.16	2.19
38	000157	中联重科	82,288,191.35	2.19
39	600325	华发股份	81,227,714.21	2.16
40	600079	人福医药	80,641,908.69	2.14
41	000525	红 太 阳	80,364,007.55	2.14
42	002146	荣盛发展	79,490,579.02	2.11
43	000869	张 裕A	78,760,815.45	2.09
44	000800	一汽轿车	78,459,668.70	2.09
45	000422	湖北宜化	77,682,432.09	2.07
46	600739	辽宁成大	75,942,643.15	2.02

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	11,926,411,974.30
卖出股票收入(成交)总额	12,569,699,912.44

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	4,204,914.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58,753.22
5	应收申购款	9,885,900.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,149,568.53

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6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	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
68,598	41,933.05	841,635,153.19	29.26%	2,034,888,032.33	70.74%

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	银华基金管理有限公司	54,466,352.00	17.96%
2	青岛国信资产管理有限公司	26,013,746.00	8.58%
3	青岛国信实业有限公司	18,000,000.00	5.93%
4	民生人寿保险股份有限公司	13,262,559.00	4.37%
5	中国人寿保险股份有限公司	9,781,487.00	3.22%
6	王远渺	6,379,531.00	2.10%
7	CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	4,595,042.00	1.51%
8	冯玉洁	2,944,210.00	0.97%
9	冯剑萍	2,873,354.00	0.95%
10	王玉清	2,048,695.00	0.68%

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	20,851.02	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年7月1日)基金份额总额	2,500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,504,466,955.77
本报告期基金总申购份额	2,010,206,394.82
减:本报告期基金总赎回份额	2,638,150,165.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,876,523,185.52

§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

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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了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
申银万国证券股份有限公司	2	5,164,421,493.55	21.10%	4,260,578.04	20.91%	-
海通证券股份有限公司	2	4,452,907,017.08	18.19%	3,650,126.38	17.91%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	3,898,878,415.12	15.93%	3,238,627.91	15.89%	-
中国银河证券股份有限公司	2	2,883,510,315.84	11.78%	2,372,319.94	11.64%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	2,389,201,585.74	9.76%	2,030,815.83	9.97%	新增2个交易单元
第一创业证券有限责任公司	1	1,786,038,199.86	7.30%	1,518,131.31	7.45%	-
中国国际金融有限公司	1	1,441,819,219.87	5.89%	1,225,536.73	6.01%	-
东北证券股份有限公司	1	793,427,987.18	3.24%	674,404.64	3.31%	-
广发证券股份有限公司	1	783,503,289.99	3.20%	665,974.07	3.27%	-
西南证券股份有限公司	1	317,652,864.02	1.30%	258,095.89	1.27%	-
中信建投证券有限责任公司	1	275,796,929.27	1.13%	234,424.32	1.15%	-
东海证券有限责任公司	1	232,866,363.81	0.95%	197,933.09	0.97%	-
湘财证券有限责任公司	1	59,709,863.79	0.24%	48,514.18	0.24%	-
华林证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	40,265,225.20	80.55%	-	-	-	-
第一创业证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	9,724,494.40	19.45%	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华林证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

银华基金管理有限公司

2011年3月30日