



(上接B26版)
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:400-888-8788,95525
公司网站:www.ebscn.cn
(46)华泰联合证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A,02,03,04)、17A、18A、24A、25A、26A
法定代表人:吴超明
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
联系人:盛宗凌
客户服务电话:95513
网站:www.lhjq.com
(47)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦10层
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
联系人:李奕鸣
客户服务咨询电话:95553,400-888-8001
网站:www.htsec.com
(48)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
联系人:马彦涛
客户服务热线:400-8888-228
公司网站:www.jyqz.com.cn
(49)国海证券股份有限公司
注册(办公)地址:广西桂林市辅星路13号
法定代表人:张雅锋
电话:0755-83709350
传真:0755-83700205
联系人:牛亚宇
客户服务电话:95563
公司网站:www.gnjq.com.cn
(50)申银万国证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54038884
客户服务电话:95523或400-889-5523
电话委托:021-962505
网站:www.swyc.com
(51)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:王殊林
传真:023-63786311
客户服务电话:400-809-6096
网站:www.swsc.com.cn
(52)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市河西区滨水道3号
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451861
传真:022-28451892
联系人:王秋虹
客户服务电话:400-6515-988
公司网站:www.bhjq.com
(53)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐文艺路233号
办公地址:北京西便门大街太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李辉
客户服务电话:400-888-8588(免长途费)
网站:http://www.hqy.com.cn
(55)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城可园南路1号
办公地址:东莞市莞城可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
客户服务电话:0769-961130
电话:0769-22116557
传真:0769-22119423
联系人:张巧玲
网站:www.djqz.com.cn
(56)锦泰证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢C楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:姚文平
客户服务电话:400-888-8128
电话:021-68761616
传真:021-68767981
网站:www.jtsec.com.cn
(57)财通证券有限责任公司
注册(办公)地址:杭州新市街15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继平
客户服务电话:0571-96336,962336(上海地区)
电话:0571-87915129
联系人:乔骏
网站:www.ctsec.com
(58)中信金通证券有限责任公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20楼
法定代表人:沈强
电话:0571-85783737
传真:0571-85106383
客户服务电话:96598
联系人:俞宏亮
网站:www.higsun.com.cn
(59)长江证券股份有限公司
注册(办公)地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡润洲
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或400-8888-999
联系人:李良
网站:www.95579.com
(60)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号17层
法定代表人:石保
客户服务电话:967218 400-813-9666
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
联系人:程月艳,张敏
网站:www.cnew.com
(61)南京证券有限责任公司
注册(办公)地址:江苏省南京市中大街9号
法定代表人:张华东
客户服务电话:400-828-5888
传真:025-5210586
联系人:李静
公司网站:www.njqz.com.cn
(62)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层
法定代表人:潘鑫军
电话:021-63325888-3108
传真:021-63326173
客户服务电话:95503
联系人:吴宇
网站:www.dfqz.com.cn
(63)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:冯晓丹
客户服务热线:0512-3396288
网站:www.dwzq.com.cn
(64)国都证券有限责任公司
注册(办公)地址:北京市东城区东直门南大街9号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常磊
客户服务电话:400-818-8118
网站:www.guodu.com
(65)山西证券股份有限公司
办公(注册)地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯翼
联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
联系人:郭娜
客户服务电话:400-666-1618
网站:www.i618.com.cn
(66)上海证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:邵圣民
电话:021-53198888
传真:021-53198888
客服电话:400-891-8918,021-962518
联系人:张祺
公司网站:http://www.962518.com
(67)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
客户服务电话:400-800-1001
网站:www.essence.com.cn
(68)中航证券有限公司
注册(办公)地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜松
电话:0791-86768681
传真:0791-6770178
联系人:余雅璇
客户服务电话:400-8866-567
网站:www.avicsec.com
(69)国元证券股份有限公司
注册(办公)地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志
电话:0551-2272100
传真:0551-2272100
联系人:祝丽萍
客户服务电话:4008-888-777
网站:www.gyqz.com.cn
(70)长城证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
传真:0755-83515567
客户服务电话:0755-33680000 400-6666-888
公司网站:www.ccgs.com.cn
(71)大同证券经纪有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
办公地址:太原市长治路111号 号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人:董祥
电话:0351-4103022
联系人:薛洋
客户服务电话:4007121212
网站:http://www.dtsbc.com.cn/
(72)华林证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:段文涛
业务联系人:杨玲
客户服务电话:北京:010-64405618 上海:021-52045595 深圳:0755-83040288 广州:020-38372715 长沙:0731-82329088 合肥:0551-2883033 江门:0750-3160388
网站:http://www.chinalions.com/
(73)恒泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:邢万兵
电话:0471-4972348
传真:0471-4961259
联系人:董建华
客户服务电话:0471-4961259
网站:www.cnht.com.cn
(74)万联证券有限责任公司
注册(办公)地址:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人:张建军
联系人:罗剑斌
电话:020-37865070
传真:020-2237718-1013
客户服务电话:400-8888-133
网站:www.wljz.com.cn
(75)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南经七路86号
法定代表人:李野
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:95538
网站:www.qlqz.com.cn
(76)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人:杨明辉
联系人:刘璇
电话:0755-82024342
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006-008-008
网站:www.cjic.com
(77)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
电话:0731-85832343
客户服务电话:95571
传真:0731-85832214
网站:http://www.founders.com
(78)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心15层
法定代表人:刘泓
客户电话:400-887-8827
网站:www.ubssecurities.com
(79)江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙洪铭
联系人:张宇宏
联系电话:0451-82336863
联系传真:0451-82287211
客服电话:400-666-2288
网站:www.jhjq.com.cn
(80)爱建证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市南京西路758号24楼
法定代表人:张建华
电话:021-32298888
联系人:陈旻
业务联系电话:021-32298888
网站:www.aijz.com.cn
(81)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人:傅耀斌
联系人:卢金文
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
客户服务电话:0592-5163588
网站:www.xmqz.com
(82)中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外甲6号SK大厦9层
法定代表人:李剑阁
电话:010-85792625
联系人:王雪莉
客户服务电话:010-85679238,010-85679169
网站:www.ciccs.com.cn
(83)华宝证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
客户服务电话:400-820-9898
网站:www.hbstock.com
(84)广州证券有限责任公司
注册(办公)地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人:刘东
电话:020-87322668
传真:020-87325036
联系人:林洁茹
客户服务电话:020-961303
网站:www.gzs.com.cn
(85)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:张永泉
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
客户服务电话:400-889-9636
网站:www.hfzq.com.cn
(86)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林文义
联系人:林霖
联系电话:010-6645608
客服电话:010-6645678
传真:010-6645500
天相投资顾问网站:http://www.txsec.com
天相基金网站:http://fjin.txsec.com
(87)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠华
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
联系传真:010-63080978
客服热线:400-800-8899
网站:www.cindasc.com
(88)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
联系电话:0931-4890208
联系传真:0931-4890628
客服电话:0931-4890208,4890100,4890619,4890618
网站:www.hlzq.com.cn
(89)西部证券股份有限公司
注册(办公)地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系电话:029-87406488
传真:029-87406387
联系人:张煜
客户服务电话:95582
网站:www.westsec.com.cn
(90)红塔证券股份有限公司
注册(办公)地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦4楼
法定代表人:况雨林
电话:0871-3577942
传真:0871-3578827
联系人:刘晓明
客户服务电话:0871-3577888
网站:www.hongtastock.com
(91)湘财证券有限责任公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6、7
法定代表人:吴显华
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客户服务电话:0571-967777
网站:www.stocke.com.cn
(92)天风证券股份有限公司
注册(办公)地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:董晖
电话:027-87618882
传真:027-87618863
客户服务电话:028-86711410/027-86718882
网站:www.tfzq.com
(93)西藏同信证券有限责任公司
注册地址:西藏自治区拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市永和路118弄24号楼
法定代表人:贾绍君
联系人:王韵
电话:021-36533017

传真:021-36533017
客户服务电话:400-881-1177
网站:www.xzsec.com
(94)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人:丁之镛
联系人:陶娟
电话:010-58568040
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网站:www.hrsec.com.cn
(95)英大证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区深南中路2068号华能大厦30、31层
法定代表人:赵文安
电话:0755-83007069
传真:0755-83007069
客户服务电话:4008-698-698
网站:www.ydsc.com.cn
基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。
(二)注册登记机关
名称:银华基金管理有限公司
住所:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层
法定代表人:彭越
电话:010-58136300
传真:010-58136327
联系人:伍雪辉
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京国枫律师事务所
住所:北京市东城区东四十条甲22号新商厦商务大厦A502室
负责人:崔建涛
电话:010-64096089
传真:010-64096188
联系人:卫宇民
经办律师:云大慧、王宇民
(四)会计师事务所及经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:李慧民、王珊珊
电话:010-58153222 010-58152145
传真:010-85188298
联系人:王珊珊
四、基金的名称
本基金名称:银华富裕主题股票型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金类型:契约型、开放式
六、基金的投资目标
本基金的投资目标是:通过选择富裕主题行业,并投资其中的优势企业,把握居民收入增长和消费升级带来的投资机会,同时严格控制风险管理,实现基金资产可持续的稳定增值。
七、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律法规和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他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
(一)资产配置策略
1.大类资产配置
本基金为主动式的股票型基金,根据对宏观经济、居民收入增长和分布状况、行业状况及资本市场走势、综合评估各类资产的风险收益水平,对各类资产采取主动、适度配置,在重点投资于富裕主题行业中优势企业的前提下实现大类资产配置,以求基金资产在股票、债券及其他金融工具的投资中实现风险-收益的最佳匹配。
2.行业配置
本基金将通过对居民收入增长和分布状况、消费升级趋势,以及富裕主题行业所涵盖的各大行业及其他细分行业的产业政策、政策环境和竞争状况进行分析和预测,确定消费升级、行业经济变量的变动对富裕主题行业及其各细分行业的潜在影响,得出各大行业及细分行业研究评级并确定基金股票资产在各行业的配置比例。
3.本基金通过定性和定量指标评估,以富裕主题行业中的各大行业及其细分行业作为研究对象,从消费拉动、行业成长性以及行业景气度三方面对行业进行投资评级。
(1)消费拉动因素是指国内人口增长、收入分配结构的改善和消费升级等因素对消费、服务类产品服务的拉动水平,及其对相关行业成长性的持续推动力。本基金管理人利用自身投资研究经验,引入定性和定量评估指标对消费拉动进行动态评估。其中,引入的指标包括:人口年龄/地域分布、居民收入水平和增长率、财富的人口/年龄分布、消费弹性、宏观政策等。
(2)行业成长的动力主要来源于消费升级和升级的拉动,但潜在的消费意愿和能力可否转化为现实的行业成长,关键要看行业/产品生命周期、行业竞争格局、社会文化/政策导向等因素是否及在多大程度上有利于实现这种转化。本基金将通过上述因素的分析与评估,确定富裕主题行业及其细分行业的成长性评级。
(3)本基金通过分析各细分行业资产收益率、固定资产周转率、存货及应收款周转率、产品或服务价格指数等变量的时间序列来评估行业的当前景气度。
(二)股票选择策略
本基金将根据企业的成长性分析来选择股票,具体分如下三步进行:
第一步:调用基础数据库,实施股票初选
本基金管理人的研究团队将进行有针对性的实地调研,集中研讨、委托课题、实证分析等多种形式的系统研究,结合卖方研究机构的覆盖调查,根据股票的流动性和估值指标对个股所有股票进行筛选,经过风险管理组审核无异议后进入和维护股票基础库。
在基础股票库的范围内,本基金将选择其中属于富裕主题行业的股票,以其为基础建立基金初级股票库,成为本基金股票投资的基本范围。
第二步:企业成长性评估,精选个股
本基金将根据居民消费升级和升级趋势,企业的产品生命周期、创新能力、市场地位、品牌优势以及管理能力等因素对企业成长性的因素,分析初级股票库内企业可持续成长的能力。本基金在投资选择时主要关注以下三类企业:
1.具备较强的市场影响力,良好的产品创新能力和准确的市场定位,能积极、适时把握居民消费升级和升级趋势的企业;
2.具有有良好的市场地位,品牌溢价和差异化优势,能够确定相对于竞争对手更高的利润率的企业;
3.具有清晰明确的发展战略,管理层具备强有力的执行力,作为行业的整合者出现,能够获取较高利润。
第三步:结合行业评估和配置,建立股票投资组合
本基金将结合行业评估结论,并根据股票市场运行情况对入选股票进行动态调整,据以作出买入、增持、持有、减持或剔除的决策,建立和调整股票投资组合。
(三)债券投资策略
本基金债券投资,将主要采取久期调整、收益率曲线配置和类属配置等策略,发现、利用市场失衡实现组合增值。
1.根据利率预期调整久期
久期调整是根据对基准利率水平的预测,增加或减小债券投资组合久期的策略。在预期基准利率下降时,适当增加组合久期,以较多地获得债券价格上升收益并获得较高的利息收入;在预期基准利率上升时,缩短组合久期,以规避债券价格下降的风险。
本基金将深入分析和研究利率走势和收益率期限结构,为积极债券投资提供基础。利率的变化与宏观经济和货币政策密切相关,研究利率走势具有很强的客观性和现实可行性。这是债券投资策略中的战略配置基础。
2.根据收益率曲线变化预期确定组合策略
收益率曲线配置是在确定组合久期后,进一步预测未来收益率曲线可能的变化形态,确定采用策略中策略,哑铃策略或梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行配置。
一般而言,当预期收益率曲线变陡时,本基金将采用集中策略;而当预期收益率曲线变平时,本基金将采用两端策略。梯形策略则是将组合平均分配在收益率曲线不同的点上,一般在预期收益率曲线不变或平行移动时采用。
3.根据收益和流动性等因素确定类属配置
类属配置包括各市场债类及各债券品种类型的配置。根据各市场、各品种的相对投资价值、流动性及信用风险,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属,借以取得较高总回报。
(四)权证投资策略
本基金将在遵循法律法规的相关规定,并严格控制风险的前提下,发掘权证的投资机会。一方面,基金管理团队将深入进行权证价格、标的价格和权证价格之间的关系,以利用非完全有效市场中的无风险套利机会。另一方面,基金管理团队将运用期权、期货估值模型,根据隐含波动率、剩余期限、标的价格变化,并结合基金自身的资产组合状况,进行权证投资,力求取得最优的风险调整收益。
九、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准定为:沪深300指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%。
由于本基金属于股票型基金,一般情况下股票投资比例大约为80%,本基金采用业界较为公认、市场代表性较好的沪深300指数和中国债券总指数加权作为本基金的业绩评价基准,权重分别为80%和20%。
若法律法规发生变化,或者证券市场中有其他代表性更强的业绩比较基准推出,基金管理人可以依据保护基金份额持有人合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。若本基金由于上述原因调整业绩比较基准,应根据投资决策委员会批准并报中国证监会备案,基金管理人将在调整前3个工作日内于中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
十、基金的风险收益特征
本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
十一、投资组合报告
一、投资组合报告
基金管理人银华基金管理有限公司的董事会及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责任。
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,于本报告期末对基金资产净值和基金投资组合等内容进行了复核,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2011年9月30日。
1.报告期末基金资产组合情况

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000527	美的电器	29,195,069	430,335,317.06	5.02
2	002024	苏宁电器	24,999,479	260,244,576.39	3.04
3	600406	国电南瑞	7,321,163	256,094,281.74	2.99
4	002422	科伦药业	4,153,770	243,037,082.70	2.84
5	002353	雅化股份	3,579,034	230,847,693.00	2.70
6	601888	中国国航	8,550,667	210,431,914.87	2.46
7	002344	海宁皮革城	8,841,266	208,565,464.94	2.44
8	600521	华海药业	10,946,537	207,159,280.02	2.42
9	000001	深发展A	14,583,337	169,756,725.48	1.98
10	300105	龙源技术	3,363,433	166,927,179.79	1.95

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,940,000.00	2.33
其中:政策性金融债	199,940,000.00	2.33	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	120,512,167.00	1.41
8	其他	-	-
9	合计	320,452,167.00	3.74

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110414	11沈沈14	2,000,000	199,940,000.00	2.33
2	120105	石化转债	1,378,700	120,512,167.00	1.41

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
8.投资组合报告附注
8.1 本基金投资的公开市场发行的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。
8.2 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。
8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,346,969.09
2	应收证券清算款	227,061,294.27
3	应收股利	-
4	应收利息	1,701,734.59
5	应收申购款	6,422,891.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	238,532,889.31

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	120,512,167.00	1.41

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
8.6 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。
十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率①	标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
2006年11月16日至2007年12月31日	20.17%	1.26%	27.72%	1.29%	-7.55%	-0.03%
2007年1月1日至2007年12月31日	110.27%	2.00%	107.13%	1.82%	3.14%	0.18%
2008年1月1日至2008年12月31日	-50.47%	2.04%	-56.29%	2.40%	5.82%	-0.36%
2009年1月1日至2009年12月31日	91.88%	1.79%	68.71%	1.63%	23.17%	0.16%
2010年1月1日至2010年12月31日	15.68%	1.36%	-9.86%	1.24%	25.54%	0.12%
2011年1月1日至2011年6月30日	-13.20%	1.10%	-1.82%	0.99%	-11.38%	0.11%
2011年7月1日至2011年9月30日	-9.98%	1.05%	-12.17%	1.05%	2.19%	0.00%
自基金合同生效起至2011年9月30日	117.05%	1.72%	51.65%	1.73%	65.40%	-0.01%

注:本基金业绩比较基准已于2011年1月1日从“新华富时A200指数收益率*80%+新华巴克莱资本中国全债指数*20%”变更为“沪深300指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%”,详情请见本公司发布的相关公告。
十三、费用概览
(一)基金费用的种类
1.与基金运作有关的费用
(1)基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=Ex年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%
E为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=Ex年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%
E为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(3)基金财产划转支付的银行费用
(4)基金合同生效后的信息披露费用
(5)基金份额持有人大会费用
(6)基金合同生效与基金有关的会计师费和律师费
(7)基金的证券交易费用
(8)在中国证监会有关规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,销售服务费的具体计提方法,计提标准在招募说明书中有其他约定
(9)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用
基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、降低基金管理费率,基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日3个工作日内在指定媒体上刊登公告。
上述第(3)到(9)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
2.与基金销售有关的费用
(1)申购费
本基金的申购费用由投资人承担,不列入基金资产,用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金采用前端收费的形式收取申购费用,申购费率按申购金额的大小分为四档,具体如下所示:

申购费率	申购金额≥50万	固定收取1000元/笔
	200元≤申购金额<50万	0.8%
	50元≤申购金额<200元	1.2%
	申购金额<50元	1.5%

(2)赎回费
本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付注册登记和其他必要的手续费。
赎回费率随投资人持有本基金基金份额的时间的增加而递减,具体如下表所示:

赎回费率	持有期<1年	0.5%
	1年≤持有期<2年	0.2%
	持有期≥2年	0

(3)转换费
基金转换时所需要的费用由转出基金赎回费用和基金管理人根据公平合理原则确定的转换费用构成。
转出基金时,如涉及的转出基金有赎回费用,收取该基金的赎回费用。
转入基金时,原则上从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时,每次收取确定的转换费用,从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时,不收取转换费用。基金管理人在不同基金间设置固定的转换费率。
不同转换方向的转换费率设置以基金管理人的相关公告为准。
(4)其他与基金销售有关的费用
上述基金费用由基金管理人按照法律法规的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日2日前在至少一种指定媒体上刊登公告。
(二)不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不得列入基金财产中支付。
(三)基金税收
本基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。
十四、对招募说明书更新部分的说明
银华富裕主题股票型证券投资基金招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求,对本基金原招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:
1.在“重要提示”部分,更新了招募说明书的修订日期及相关财务数据的截止日期。
2.在“二、释义”中,根据证监会对《销售管理办法》的修订情况,对“《销售管理办法》”的释义进行了更新;
3.在“三、基金管理人”中,对基金管理人的概况及主要人员情况进行了更新。
4.在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。
5.在“五、相关服务机构”部分,对本基金管理人北京直销中的地址及联系人信息进行了更新,删除了本基金管理人上海分公司的相关信息;增加哈尔滨银行股份有限公司、佛山顺德农村商业银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、浙江稠州商业银行股份有限公司以及英大证券有限责任公司为代销机构,更新了部分代销机构的资料;对本基金经注册会计师审计进行了更新。
6.在“九、基金的投资”部分,更新了最近一期投资组合报告的内容。
7.在“十、基金的业绩”部分,更新了截至2011年9月30日的基金投资业绩。
8.在“二十二、其他应披露事项”中,对自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的重要公告信息进行了更新。
9.对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司
2011年12月31日