银华沪深300指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

（2012年第1号）

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

重要提示

本基金经2009年8月17日中国证券监督管理委员会证监许可〔2009〕793号文核准募集。

本基金合同生效日期：2009年10月14日。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

本基金按照份额初始面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于初始份额面值。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过前一开放日基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为2012年4月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日，所披露的投资组合为2012年1季度的数据（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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：王立新（代）
设立日期：2001年5月28日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监基金字〔2001〕7号
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：刘晓雅
电话：010-85186558
传真：010-58163027

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49%）、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1%）。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。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“风险控制委员会”和“薪酬与提名委员会”2个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由3位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理部、量化投资部、研究部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、境外投资部、特定资产管理部、交易管理部、固定收益部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、总经理（董事会）办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部等18个职能部门，并设有北京分公司。此外，公司还设有A股基金投资决策委员会、境外投资决策委员会、特定资产投资决策委员会3个投资决策委员会，分别负责指导基金及其他投资组合的运作，确定基本的投资策略。

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

王珠林先生：董事，经济学博士。历任甘肃省职工财经学院财会系讲师；甘肃省证券公司经理；蓝星清洗股份有限公司董事、副总经理；西南证券有限责任公司副总裁；中国银河证券股份有限公司副总裁；西南证券股份有限公司董事、总裁。现任西南证券股份有限公司董事、银华基金管理有限公司董事，兼任中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、财政部资产评估准则委员会委员，并曾担任中国证监会第七、八届发行审核委员会委员、中国证券业协会第一、二、三届投资银行专业委员会委员。

钱龙海先生：董事，经济学硕士。曾任北京京放投资管理顾问公司总经理助理；佛山证券有限责任公司副总经理。现任第一创业证券有限责任公司党委书记、董事、总裁，兼任第一创业投资管理有限公司董事长、第一创业摩根大通证券有限责任公司董事。还担任中国证券业协会第五届理事会理事，中国证券业协会投资银行业务委员会第五届副主任委员，深圳市证券业协会副会长。

矫正中先生：董事，中共党员，经济学硕士，中国注册会计师。曾任吉林省财政厅工交企业财务处副处长（正处级）；吉林省长岭县副县长；吉林省财政厅文教行政财务处处长；吉林省财政厅副厅长、厅长兼吉林省地税局局长；吉林省政府秘书长兼办公厅主任、副省长，兼吉林市代市长、书记。现任东北证券股份有限公司董事长、党委书记。

周晓冬先生：董事，金融MBA、国际商务师。曾任中国南光进出口总公司广东分公司总经理；上海海博鑫惠国际贸易有限公司董事、常务副总经理。现任海鑫钢铁集团有限公司董事长助理，兼任北京惠宇投资有限公司总经理。

王立新先生：董事总经理、代董事长，经济学博士。历任中国工商银行总行科员；南方证券股份有限公司基金部副处长；南方基金管理有限公司研究开发部、市场拓展部总监；银华基金管理有限公司总经理助理、副总经理、代总经理。现任银华基金管理有限公司总经理、代董事长。

郑秉文先生：独立董事，经济学博士后，教授，博士生导师。曾任中国社会科学院培训中心主任，院长助理，副院长。现任中国社会科学院拉美研究所所长。

王恬先生：独立董事，大学学历，高级经济师。曾任中国银行深圳分行行长，深圳天骥基金董事，中国国际财务有限公司（深圳）董事长，首长四方（集团）有限公司执行董事。现任南方国际租赁有限公司董事、总裁。

陆志芳先生：独立董事，法律硕士，律师。曾任对外经济贸易大学法律系副主任，北京仲裁委员会仲裁员，北京市律师协会国际业务委员会副主任委员，海问律师事务所律师、合伙人。现任浩天信和律师事务所律师、合伙人。

高歌女士：独立董事，法律硕士。曾任高阳科技控股有限公司助理总裁；普天系统集成公司副总经理；新华锦集团副总裁、副董事长。现任中国民主建国会青岛市委员会副主委、全国青联委员、中国青年企业家协会常务理事、新华锦集团副董事长。

周兰女士：监事会主席，中国社会科学院货币银行学专业研究生学历。曾任北京建材研究院财务科长；北京京放经济发展公司计财部经理；佛山证券有限责任公司监事长及风险控制委员会委员。现任第一创业证券有限责任公司监事长及风险控制委员会委员。

王宜四先生，监事，经济学博士。曾任中国人民银行安徽省分行副科长；安徽省证券公司深圳营业部及深圳总部总经理；华安证券有限责任公司副总裁；北方证券有限责任公司总裁；天风证券有限责任公司总裁；中国建银投资证券有限责任公司首席运营官（副总裁）。现任西南证券股份有限公司副总裁。

杜永军先生：监事，大专学历。曾任五洲大酒店财务部收款主管；北京赛特饭店财务部收款主管、收款主任、经理助理、副经理、经理。现任银华基金管理有限公司行政财务部财务主管。

鲁颂宾先生：副总经理，经济学博士。曾任中国交通进出口总公司销售经理；中国证监会信息监管部主任科员；中国证监会办公厅主任科员、副处长、处长。现任银华基金管理有限公司副总经理。

陆文俊先生：副总经理，经济学学士。曾任君安证券有限责任公司人力资源部行政主管、交易部经理，上海华创创投资管理事务所合伙人，富国基金管理有限公司交易员，东吴证券有限责任公司投资经理、资产管理部副总经理，长信基金管理有限责任公司研究员、长信金利趋势股票型证券投资基金基金经理等职。2008年6月加盟银华基金管理有限公司，曾任公司A股基金投资总监及公司总经理助理职务，现任银华基金管理有限公司副总经理。自2008年10月21日起，担任银华核心价值优选股票型证券投资基金基金经理，自2009年4月27日起兼任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2010年10月8日至2011年10月18日期间担任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理。

封树标先生：副总经理，工学硕士。曾任国信证券天津营业部经理、平安证券综合研究所副所长、平安证券资产管理事业部总经理、平安大华基金管理有限责任公司总经理、广发基金机构投资部总经理等职。2011年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司总经理助理职务，现任银华基金管理有限公司副总经理，同时兼任公司特定资产管理部投资经理。

凌宇翔先生：督察长，工商管理硕士。曾任机械工业部主任科员；重庆国际信托投资公司研发中心部门经理；西南证券有限责任公司基金管理部总经理。现任银华基金管理有限公司督察长。

2.本基金基金经理

周大鹏先生，硕士学位；毕业于中国人民大学；2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职。自2011年9月26日起担任本基金基金经理。

本基金历任基金经理：
路志刚先生，管理本基金的时间为2009年10月14日至2010年9月20日；
周毅先生，管理本基金的时间为2010年6月21日至2011年12月6日。

3.A股基金投资决策委员会成员
委员会主席：王立新
委员会副主席：陆文俊
委员：封树标、金斌、姜永康、王华、周毅、郭建兴
王立新先生：详见主要人员情况。
陆文俊先生：详见主要人员情况。
封树标先生：详见主要人员情况。

金斌先生，硕士学位。曾在国泰君安证券股份有限公司从事行业研究工作。2004年8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、研究主管及研究部总监等职。现任银华优势企业证券投资基金基金经理。

姜永康先生，硕士学位。2001年至2005年曾就职于中国平安保险（集团）股份有限公司，历任研究员、组合经理等职。2005年9月加盟银华基金管理有限公司，曾任养老金管理部投资经理职务。曾担任银华货币市场证券投资基金基金经理。现任银华保本增值证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金以及银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，同时兼任公司固定收益部总监及固定收益基金投资总监。

王华先生，硕士学位，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于西南证券有限责任公司。2000年10月加盟银华基金管理有限公司（筹），先后在研究策划部、基金经理部工作，曾任银华保本增值证券投资基金、银华货币市场证券投资基金基金经理。现任银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理、公司总经理助理、投资管理部总监及A股基金投资总监。

周毅先生，硕士学位，CFA；曾任美国普华永道金融服务部部门经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009年9月加入银华基金管理有限公司，现任银华深证100指数分级证券投资基金及银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理职务，同时担任公司总经理助理、量化投资总监、量化投资部总监以及境外投资部总监。

郭建兴先生，学士学位。曾在山西证券股份有限公司（原山西证券有限责任公司）从事证券自营业务工作，历任交易主管、总经理助理兼监理等职；并曾就职于华商基金管理有限公司投资管理部，曾担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司，现任银华优质增长股票型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕12号
联系人：尹　东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011 年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年“世界银行品牌500 强”中位列第10，较去年上升3 位；在美国《财富》世界500 强中排名第108 位，较去年上升8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

（1）银华基金管理有限公司北京直销中心
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
电话：010-58162950
传真：010-58162951
联系人：展璐
网址：www.yhfund.com.cn
全国统一客户服务电话：400-678-3333

（2）银华基金管理有限公司深圳直销中心
地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层
电话：0755-83515002
传真：0755-83515082
联系人：饶艳艳

2.代销机构

（1）场外代销机构

1）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：王洪章
客户服务电话：95533（全国）
网址：www.ccb.com

2）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
电话：010-66596688
传真：010-66594946
客户服务电话：95566（全国）
网址：www.boc.cn

3）中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

4）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：傅育宁
联系人：邓炯鹏
电话：0755-83198888
传真：0755-83195050
客户服务电话：95555
公司网站：www.cmbchina.com

5）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客户服务热线：95599
网址：www.abchina.com

6）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408483
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

7）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
客户服务电话：95568
传真：010-57092611
网址：www.cmbc.com.cn

8）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
法定代表人：吉晓辉
客户服务电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

9）中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人：刘安东
客户服务电话：95580
网址：www.psbc.com

10）广发银行股份有限公司
注册地址：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
客户服务热线：400-830-8003
网址：www.gdb.com.cn

11）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
联系人：丰靖
电话：010-65557083
传真：010-65550827
客户服务热线：95558
公司网站：http://bank.ecitic.com

12）北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
电话：010-66223584
传真：010-66226045
客户服务电话：010-95526
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

13）深圳发展银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
联系人：张青
电话：0755-82088888
客户服务电话：95501
公司网站：www.sdb.com.cn

14）华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
客户服务电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

15）平安银行股份有限公司
注册地址：中国深圳市深南中路1099号
法定代表人：孙建一
联系人：蔡宇洲
电话：0755-22197874
传真：0755-25879453
客户服务热线：95511-3
公司网站：http://bank.pingan.com/

16）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勋
电话：0574-89068340
传真：0574-87050024
客户服务热线：96528，上海、北京地区：962528
公司网站：www.nbcb.com.cn

17）杭州银行股份有限公司
注册（办公）地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人：马时雍
电话：0571-85108309
传真：0571-85151339
联系人：严峻
客户服务电话：0571-96523，400-8888-508
网址：www.hzbank.com.cn

18）乌鲁木齐市商业银行股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市新华北路8号
办公地址：新疆乌鲁木齐市新华北路8号
法人代表：农惠臣
联系人：何佳
电话：0991-8824667
传真：0991-8824667
客服电话：96518
网址：www.uccb.com.cn

19）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号
法定代表人：胡平西
基金业务联系人：吴海平
客服电话：021-962999
公司网站：www.srcb.com

20）重庆银行股份有限公司
注册（办公）地址：重庆市渝中区邹容路153号
法定代表人：马千真
联系人：孔文超
电话：023-63792406
传真：023-63792412
客服电话：96899（重庆地区）、400-709-6899（其他地区）
网址：www.cqcbank.com

21）中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：陈忠
客户服务电话：95558
网址：www.citics.com

22）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
传真：010-65182261
联系人：权唐
客户服务电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

23）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
联系电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户咨询电话：0532-96577
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

24）第一创业证券股份有限公司
注册（办公）地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B座25、26层
法定代表人：刘学民
电话：0755-25832852
传真：0755-82485081
客户服务电话：400-888-1888
网址：www.firstcapital.com.cn

25）平安证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
全国免费业务咨询电话：95511-8
网址：www.pa18.com

26）兴业证券股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

27）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
电话：021-38676666
传真：021-38670666
联系人：芮敏祺
客户服务电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

28）广发证券股份有限公司
注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点
传真：020-87555417
联系人：黄岚
网址：http://www.gf.com.cn

29）国信证券股份有限公司
注册（办公）地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

30）中银国际证券有限责任公司
注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：许刚
客户服务电话：400-620-8888
联系人：李丹
网址：www.bocichina.com

31）光大证券股份有限公司
注册（办公）地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：400-888-8788　10108998　95525
公司网站：www.ebscn.com

32）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：李笑鸣
客户服务咨询电话：95553、400-888-8001
网址：www.htsec.com

33）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：马贤清
客户服务热线：400-888-8228
公司网站：www.jyzq.com.cn

34）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：021-54033888
传真：021-54038844
客户服务电话：95523或400-889-5523
电话委托：021-962505
网址：www.cywg.com

35）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：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
客户服务电话：400-6515-988
公司网址：www.bhzq.com

36）东海证券有限责任公司
注册（办公）地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：李涛
免费服务热线：400-888-8588（免长途费）
网址：http://www.longone.com.cn

37）德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9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
网址：www.tebon.com.cn

38）东吴证券有限责任公司
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：方晓丹
客户服务热线：0512-33396288
网址：http://www.dwzq.com.cn

39）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3号国华投资大厦9、10层
法定代表人：常喆
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

40）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：侯巍
联系电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
联系人：郭熠
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

41）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：郁忠民
电话：021-53519888
传真：021-53519888
客服电话：4008918918、021-962518
联系人：张瑾
公司网址：http://www.962518.com

42）安信证券股份有限公司
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
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
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
客户服务电话：400-800-1001
网址：http://www.essence.com.cn

43）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：400-8888-777
网址：www.gyzq.com.cn

44）长城证券有限责任公司
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.cgws.com

45）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：庞介民
电话：0471-4972343
传真：0471-4961259
联系人：王旭华
客户服务电话：0471-4960762
网址：www.cnht.com.cn

46）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：罗创斌
电话：020-37865070
传真：020-22373718-1013
客户服务电话：400-8888-133
网址：www.wlzq.com.cn

47）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：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

48）江海证券有限公司
注册（办公）地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
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
网址：www.jhzq.com.cn

49）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市南京西路758号24楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：张建华
电话：021-32229888
联系人：陈敏
传真：021-68728703
网址：www.ajzq.com

50）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
网址：www.cnhbstock.com

51）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：黄金琳
电话：0591-87383623
传真：0591-87841150
客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.hfzq.com.cn

52）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
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：王宜四（代）
传真：023-63786311
客户服务电话：400-809-6096
网址：www.swsc.com.cn

53）财通证券有限责任公司
注册（办公）地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
客户服务电话：0571-96336，962336（上海地区）
电话：0571-87915129
网址：www.ctsec.com

54）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：傅毅辉
联系人：卢金文
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
客服电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn

55）东北证券股份有限公司
注册（办公）地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
开放式基金咨询电话：0431-85096709
客户服务电话：400-600-0686　0431-85096733
网址：www.nesc.cn

56）中国银河证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
客户服务电话：400-888-8888
电话：010-66568430
传真：010-83574087
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn

57）华泰证券股份有限公司
注册（办公）地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-83290834
传真：025-51863323
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

58）湘财证券有限责任公司
注册（办公）地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634510
传真：021-68865680
联系人：钟康莺
开放式基金咨询电话：400-888-1551
网址：www.xcsc.com

59）南京证券有限责任公司
注册（办公）地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
客户服务电话：400-828-5888
传真：025-52310586
联系人：李铮
公司网站：www.njzq.com.cn

60）中信证券（浙江）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层、20楼
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
电话：0571-87112510
传真：0571-86065161
客户服务电话：96598
网址：www.bigsun.com.cn

61）招商证券股份有限公司
注册（办公）地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务电话：400-8888-111，95565
网址：www.newone.com.cn

62）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
网址：www.gzs.com.cn

63）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号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人：董祥
电话：0351-4130322
联系人：薛津
客户服务电话：4007121212
网址：http://www.dtsbc.com.cn/

64）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：石保上
客户服务电话：967218　、400-813-9666
电话：0371-65585670
传真：0371-65585665
联系人：程月艳、耿铭
网址：www.ccnew.com

65）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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
联系电话：010-66045608
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
天相投顾网址：http://www.txsec.com
天相基金网网址：http://jijin.txsec.com

66）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：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务热线：95579或400-8888-999
联系人：李良
网址：www.95579.com

67）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：刘弘
客户电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com

68）世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42层
法定代表人：卢长才
开放式基金咨询电话：0755-83199511
开放式基金业务传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn

69）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

70）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
开放式基金咨询电话：0755-83709350
开放式基金业务传真：0755-83700205
联系人：牛孟宇
客户服务电话：95563
公司网站：www.ghzq.com.cn

71）方正证券股份有限公司
注册（办公）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
开放式基金咨询电话：95571
电话：0731-85832343
开放式基金业务传真：0731-85832214
网址：http://www.foundersc.com

72）信达证券股份有限公司
办公（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：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
联系传真：010-63080978
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

73）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
网址：www.hlzqgs.com

74）西部证券股份有限公司
注册（办公）地址：西安市东新街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：冯萍
客户服务电话：95582
网址：www.westsecu.com.cn

75）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9楼
法定代表人：况雨林
电话：0871-3577946
传真：0871-3578827
联系人：高国泽
客户服务电话：0871-3577930
网址：www.hongtastock.com

76）浙商证券有限责任公司
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：吴承根
电话：0571-87901053
传真：0571-87901913
客户服务电话：0571-967777
网址：www.stocke.com.cn

77）天风证券有限责任公司
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4楼
法定代表人：余磊
联系人：翟璟
电话：027-87618882
传真：027-87618863
客户服务电话：028-86711410/027-87618882
网址：www.tfzq.com

78）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：王钧
电话：021-36533017
传真：021-36533017
客户服务电话：400-881-1177
网址：www.xzsec.com

79）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
网址：www.ydsc.com.cn

80）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：丁之锁
联系人：陶颖
电话：010-58568040
传真：010-58568062
客户服务电话：010-58568118
网址：www.hrsec.com.cn

81）国开证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安华外馆斜街甲1号泰利明苑写字楼A座二区4层
办公地址：北京市东城区东直门南大街1号来福士中心办公楼25层
法定代表人：黎维彬
联系人：朱瑜
电话：010-51789309
传真：010-51789307
公司网站：www.gkzq.com.cn

82）日信证券有限责任公司
注册（办公）地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系人：冯杰
电话：010-83991743
传真：010-66412537
客户服务电话：010-83991728
网址：http://www.rxzq.com.cn

83）大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：张智河
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
客户服务热线：4008-169-169
公司网站：www.daton.com.cn

（2）场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

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）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：陈耀先
联系人：朱立元
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
电话：010-66210988，010-59378888
传真：010-66210938

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市众一律师事务所
住所：北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室
办公地址：北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室
负责人：常建
电话：010-64096089
传真：010-64096188
联系人：云大慧
经办律师：云大慧、胡广志

（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
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安永大楼（即东3办公楼）16层
法定代表人：葛明
经办注册会计师：李慧民、王珊珊
电话：010-58153322；010-58152145
传真：010-85188298
联系人：王珊珊

五、基金的类型

股票型基金

六、基金的运作方式

上市契约型开放式

七、基金的投资目标

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%。

八、基金的投资范围

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。

九、基金的投资策略

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。基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后公告。

1.资产配置策略

本基金管理人主要按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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%。

2.股票投资组合构建

（1）组合构建原则

本基金原则上通过完全复制指数的方法，根据沪深300指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

（2）组合构建方法

本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪沪深300指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。

（3）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据沪深300指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与沪深300指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

①定期调整

根据沪深300指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

②临时调整

A.当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B.根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪沪深300指数；

C.根据法律、法规的规定，成份股在沪深300指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

（4）投资绩效评估

本基金日均跟踪偏离度的绝对值力争不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施将跟踪误差控制在限定的范围之内。

3.投资决策依据和决策流程

1）决策依据

（1）国家有关法律、法规、基金合同和标的指数编制、调整等相关规定，以及基金管理人事先制定的指数复制和跟踪策略，并以维护基金份额持有人利益为最高准则；

（2）国家宏观经济运行态势和证券市场走势。

2）决策程序

（1）投资管理部金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，依此提出研究分析报告；

（2）A股投资决策委员会依据投资管理部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策；

（3）根据标的指数，结合研究报告，基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合，在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低交易成本、控制投资风险；

（4）交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易；

（5）投资管理部绩效与风险评估小组根据市场变化定期和不定期对投资组合进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制；

（6）基金经理根据跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、投资管理部和监察稽核部提供的绩效评估报告以及对各种风险的监控和评估结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

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）。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在基金管理人和基金托管人协商一致，履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、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。

十二、投资组合报告

基金管理人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根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2012年3月31日（财务数据未经审计）。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	376,608,035.38	94.18
	其中：股票	376,608,035.38	94.18
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	23,027,629.29	5.76
6	其他资产	258,285.15	0.06
7	合计	399,893,949.82	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,412,867.56	0.60
B	采掘业	41,910,309.63	10.50
C	制造业	132,250,512.07	33.13
C0	食品、饮料	27,271,845.55	6.83
C1	纺织、服装、皮毛	1,025,638.88	0.26
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,785,191.96	1.95
C5	电子	3,756,723.26	0.94
C6	金属、非金属	32,085,903.03	8.04
C7	机械、设备、仪表	43,994,280.99	11.02
C8	医药、生物制品	16,153,600.60	4.05
C99	其他制造业	177,327.80	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,836,678.96	2.21
E	建筑业	9,983,307.72	2.50
F	交通运输、仓储业	11,107,224.66	2.78
G	信息技术业	12,343,401.67	3.09
H	批发和零售贸易	10,544,982.30	2.64
I	金融、保险业	117,657,882.14	29.48
J	房地产业	19,075,676.84	4.78
K	社会服务业	3,006,687.08	0.75
L	传播与文化产业	823,698.57	0.21
M	综合类	6,654,806.18	1.67
	合计	376,608,035.38	94.36

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

3.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股票投资明细

3.1报告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

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	600036	招商银行	982,144	11,687,513.60	2.93
2	600016	民生银行	1,794,179	11,249,502.33	2.82
3	601318	中国平安	266,146	9,735,620.68	2.44
4	601398	工商银行	2,058,101	8,911,577.33	2.23
5	601328	交通银行	1,818,771	8,566,411.41	2.15
6	601166	兴业银行	599,892	7,990,561.44	2.00
7	600000	浦发银行	888,825	7,937,207.25	1.99
8	601088	中国神华	262,036	6,710,741.96	1.68
9	600519	贵州茅台	32,986	6,496,922.56	1.63
10	000002	万　科A	768,739	6,365,158.92	1.59

3.2报告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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.报告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

注：本基金本报告期末未持有债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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。

8.2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	12,416.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,674.12
4	应收利息	5,091.51
5	应收申购款	228,103.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,285.15

8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票未有流通受限情况。

8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票未有流通受限情况

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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

十三、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	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
2009.10.14至2009.12.31	8.00%	1.37%	11.22%	1.59%	-3.22%	-0.22%
2010.1.1至2010.12.31	-11.85%	1.50%	-11.78%	1.50%	-0.07%	0.00%
2011.1.1至2011.12.31	-23.74%	1.23%	-23.83%	1.23%	0.09%	0.00%
2012.1.1至2012.3.31	3.99%	1.44%	4.46%	1.44%	-0.47%	0.00%
自基金合同生效日（2009.10.14）起至2012.3.31	-24.50%	1.38%	-21.94%	1.40%	-2.56%	-0.02%

十四、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金财产拨划支付的银行费用；
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后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）基金上市初费和上市月费；
（9）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在本招募说明书或相关公告中载明；
（10）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2.上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（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0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数
H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0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数
H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）除管理费和托管费之外的基金费用，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。

4.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从基金财产中支付。

5.基金管理费和基金托管费的调整

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和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用主要包括基金的认购费、申购费、赎回费、转换费等，上述费用具体的费率、计算公式、收取使用方式等内容请参见本招募说明书“六、基金的募集”、“八、基金份额的上市交易、申购、赎回与转换”。

（三）基金税收

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。

十五、对招募说明书更新部分的说明

银华沪深300指数证券投资基金（LOF）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，更新了招募说明书内容的截止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”中，删除了本基金管理人上海分公司相关信息；增加日信证券有限责任公司及大通证券股份有限公司为代销机构，删除代销机构华泰联合证券有限责任公司的相关信息，并更新了部分代销机构的资料；对本基金经办注册会计师信息进行了更新；
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2012年3月31日的基金投资业绩；
8、在“二十二、其他应披露事项”，列出了自上次招募说明书公告之日以来涉及本基金的重要公告；
9、对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司
2012年5月28日