

银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 2011 年年度报告

2011 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

送出日期：2012 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2012 年 3 月 23 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

8.9 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末上市基金前十名持有人	51
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	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息	60
§13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)
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	534,016,629.74 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
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王立新(代)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	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(即东 3 办公楼) 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2011 年	2010 年	2009 年 10 月 14 日 (基金合同生效日) -2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-14,926,214.84	-4,881,124.48	2,527,549.83
本期利润	-123,635,449.63	-64,541,268.79	43,189,093.93
加权平均基金份额本期利润	-0.2278	-0.1089	0.0753
本期加权平均净值利润率	-25.50%	-11.61%	7.18%
本期基金份额净值增长率	-23.74%	-11.85%	8.00%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-146,548,472.97	-23,742,079.34	2,575,937.86
期末可供分配基金份额利润	-0.2744	-0.0479	0.0044

期末基金资产净值	387,468,156.77	471,998,537.14	627,312,361.40
期末基金份额净值	0.726	0.952	1.080
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-27.40%	-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认购或交易基金的各项费用，例如：上市基金交易佣金、开放式基金认购、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

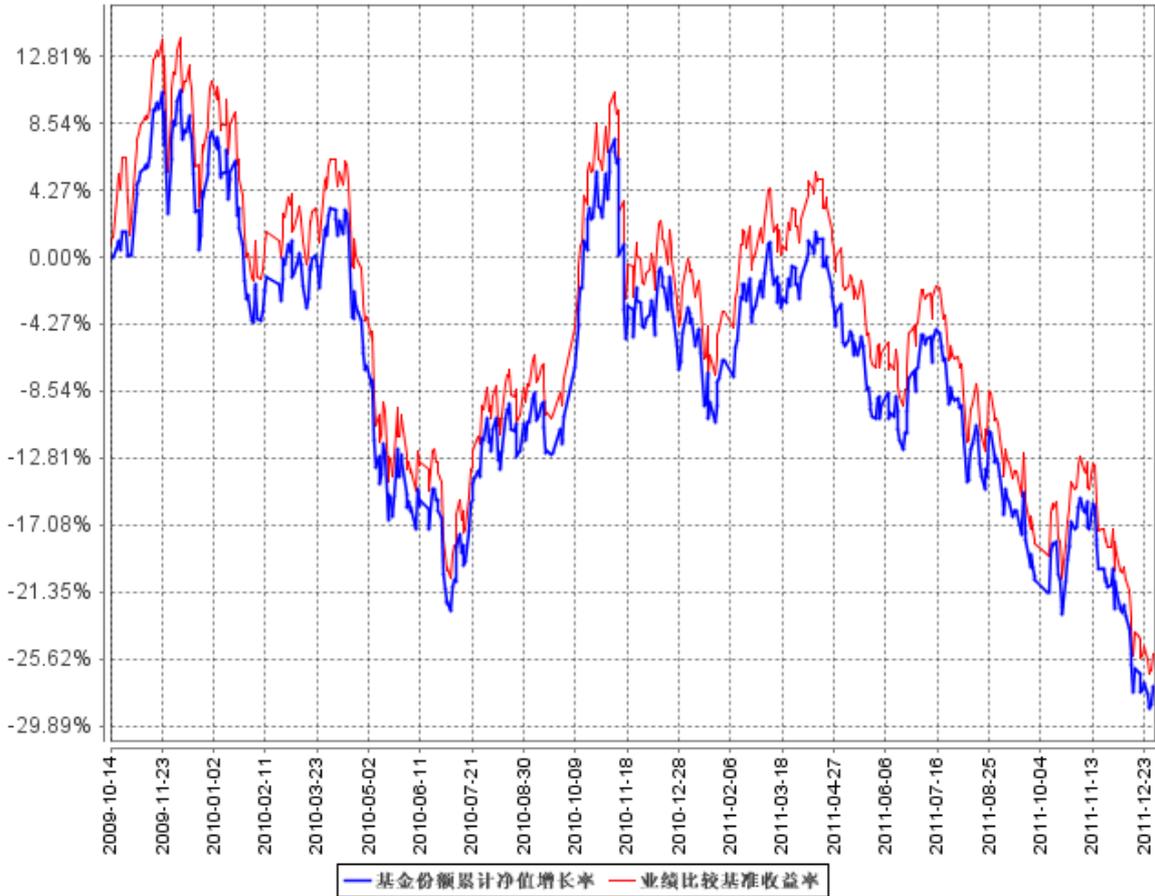
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.68%	1.34%	-8.66%	1.34%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-21.77%	1.29%	-21.88%	1.29%	0.11%	0.00%
过去一年	-23.74%	1.23%	-23.83%	1.23%	0.09%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-27.40%	1.37%	-25.27%	1.40%	-2.13%	-0.03%

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

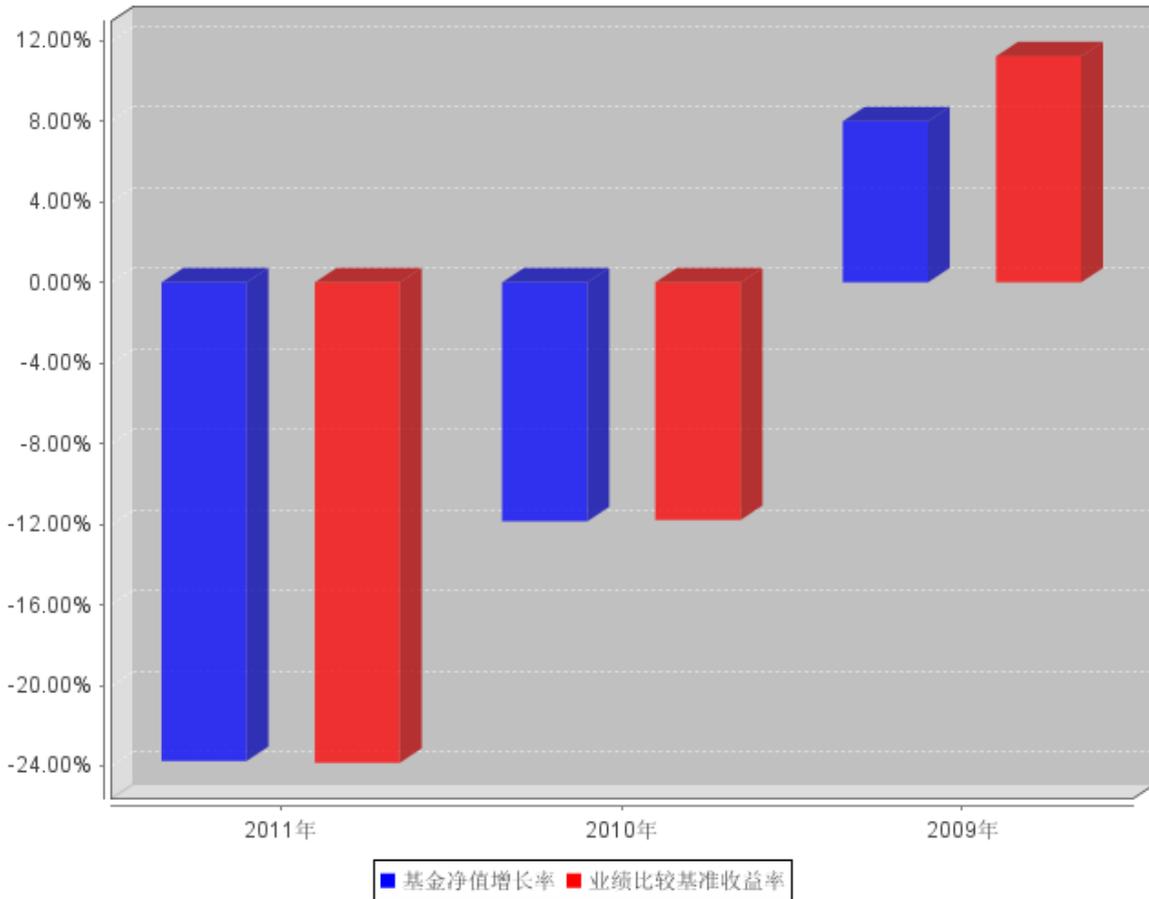
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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对比图



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

注：本基金于 2011 年、2010 年以及 2009 年 10 月 14 日（合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日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，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券有限责任公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 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。

截至 2011 年 12 月 31 日, 本基金管理人管理着 22 只开放式证券投资基金和 1 只创新型封闭式证券投资基金, 具体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)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金和银华信用债券型证券投资基金。同时, 本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2011 年 9 月 26 日	-	3 年	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。具有从业资格。国籍: 中国。
周毅先生	本基金的基金经理、公司总经理助理、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	2011 年 12 月 6 日	13 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、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。

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合规守信情况的说明

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

在报告期内,我们运用自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

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 0.726 元,本报告期份额净值增长率为-23.74%,同期业绩比较基准增长率为-23.83%。报告期内,本基金日均跟踪误差控制在 0.35%之内,年化跟踪误差控制在 4%

之内。

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 2012 年，通胀回落后，货币政策有了转向的基础，我们认为未来货币政策将适度放松，但是货币传导到实体经济还需要时间，地产、工业投资将继续大幅下滑；2011 年劳动者收入的持续提高，或将促进消费增长；外围经济的恶化，仍将限制出口的增长。总体看来，经济增速将呈现放缓态势。政策上的维稳，除对冲经济增长外，是否会有额外的宽松，仍有待观察。由于经济必然放缓，政策的放松却未必会超出预期，市场不具有趋势性机会，但投资者的恐慌预期和情绪得到宣泄后，在估值的支撑下，存在阶段性震荡上行的机会。

作为被动投资的基金，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标，期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同基金的特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。首先，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果，部门总监签字确认后，将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，本基金管理人还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节，持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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

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验。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。

4.8 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关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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2012）审字第 60468687_A11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表, 2011 年度的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表和财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银华基金管理有限公司的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为, 上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	李慧民 王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2012 年 3 月 23 日

§ 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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	20,916,835.28	25,898,717.56
结算备付金		2,031.51	396,802.16
存出保证金		13,880.68	21,147.24
交易性金融资产	7.4.7.2	366,864,632.59	443,184,220.68
其中：股票投资		366,864,632.59	443,184,220.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,456,442.10
应收利息	7.4.7.5	4,780.62	7,661.92
应收股利		-	-
应收申购款		37,792.78	732,727.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		387,839,953.46	472,697,719.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		63,171.99	32,580.39
应付管理人报酬		170,068.70	218,813.84
应付托管费		51,020.61	65,644.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	37,464.35	332,051.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,071.04	50,092.16
负债合计		371,796.69	699,181.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	534,016,629.74	495,740,616.48
未分配利润	7.4.7.10	-146,548,472.97	-23,742,079.34
所有者权益合计		387,468,156.77	471,998,537.14
负债和所有者权益总计		387,839,953.46	472,697,719.11

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.726 元，基金份额总额为 534,016,629.74 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-119,126,614.36	-59,053,885.31
1.利息收入		207,493.22	283,151.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	207,493.22	283,151.84
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）		-10,806,868.30	-471,909.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-16,690,200.22	-6,316,682.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,883,331.92	5,844,773.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-108,709,234.79	-59,660,144.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	181,995.51	795,016.32
二、费用		4,508,835.27	5,487,383.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,423,119.29	2,778,347.06

2. 托管费	7.4.10.2.2	726,935.85	833,504.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	927,018.79	1,442,569.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	431,761.34	432,963.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-123,635,449.63	-64,541,268.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-123,635,449.63	-64,541,268.79

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	495,740,616.48	-23,742,079.34	471,998,537.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-123,635,449.63	-123,635,449.63
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）	38,276,013.26	829,056.00	39,105,069.26
其中：1. 基金申购款	238,745,787.83	-11,621,720.39	227,124,067.44
2. 基金赎回款	-200,469,774.57	12,450,776.39	-188,018,998.18
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）	534,016,629.74	-146,548,472.97	387,468,156.77
项目	上年度可比期间 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	580,639,981.57	46,672,379.83	627,312,361.40

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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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。

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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估

值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金

份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(2)收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额;

(3)本基金收益每年最多分配 6 次,每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 30%;

(4)若基金合同生效不满三个月则可不进行收益分配;

(5)登记在注册登记系统的基金份额,其基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式为现金分红,投资者不能选择其他的分红方式,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

(6)基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过十五个工作日;

(7)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	20,916,835.28	25,898,717.56
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	20,916,835.28	25,898,717.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	494,572,467.59	366,864,632.59	-127,707,835.00
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	494,572,467.59	366,864,632.59	-127,707,835.00
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	462,182,820.89	443,184,220.68	-18,998,600.21
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	462,182,820.89	443,184,220.68	-18,998,600.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,777.93	7,454.65
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	0.99	152.79
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1.70	54.48
其他	-	-
合计	4,780.62	7,661.92

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	37,464.35	332,051.40
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	37,464.35	332,051.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	71.04	87.16
预提费用	50,000.00	50,000.00
其他	-	5.00

合计	50,071.04	50,092.16
----	-----------	-----------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	495,740,616.48	495,740,616.48
本期申购	238,745,787.83	238,745,787.83
本期赎回(以“-”号填列)	-200,469,774.57	-200,469,774.57
本期末	534,016,629.74	534,016,629.74

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,467,837.18	-22,274,242.16	-23,742,079.34
本期利润	-14,926,214.84	-108,709,234.79	-123,635,449.63
本期基金份额交易产生的变动数	-215,659.36	1,044,715.36	829,056.00
其中：基金申购款	-1,304,632.10	-10,317,088.29	-11,621,720.39
基金赎回款	1,088,972.74	11,361,803.65	12,450,776.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,609,711.38	-129,938,761.59	-146,548,472.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
	活期存款利息收入	201,277.78
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,044.17	5,465.74
其他	2,171.27	9,321.41
合计	207,493.22	283,151.84

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	286,740,605.34	496,347,844.21
减: 卖出股票成本总额	303,430,805.56	502,664,526.65
买卖股票差价收入	-16,690,200.22	-6,316,682.44

7.4.7.13 债券投资收益

注: 本基金本报告期和上年度可比期间未发生债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

注: 本基金本报告期和上年度可比期间未发生衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,883,331.92	5,844,773.28
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,883,331.92	5,844,773.28

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-108,709,234.79	-59,660,144.31
——股票投资	-108,709,234.79	-59,660,144.31
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-108,709,234.79	-59,660,144.31

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12
----	------------------------------	--------------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
基金赎回费收入	181,995.51	795,016.32
合计	181,995.51	795,016.32

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	927,018.79	1,442,569.08
银行间市场交易费用	-	-
合计	927,018.79	1,442,569.08

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	3,761.34	6,463.19
账户服务费	18,000.00	16,500.00
合计	431,761.34	432,963.19

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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（“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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
第一创业	1,643,483.25	0.27%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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
第一创业	1,397.11	0.27%	-	-

注：（1）上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务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。

（2）本基金上年度可比期间未发生应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,423,119.29	2,778,347.06
其中：支付销售机构的客户维护费	579,232.48	726,974.85

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	726,935.85	833,504.15

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：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	20,916,835.28	201,277.78	25,898,717.56	268,364.69

7.4.10.6 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

上年度可比期间 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：本基金于本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
000768	西飞国际	2011年12月28日	重大事项	7.26	2012年1月4日	7.61	100,718	1,350,530.29	731,212.68	-
600132	重庆啤酒	2011年12月23日	重大事项	28.45	2012年1月10日	25.61	24,282	1,408,968.17	690,822.90	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	20,916,835.28	-	-	-	-	-	-	-	-	20,916,835.28
结算备付金	2,031.51	-	-	-	-	-	-	-	-	2,031.51
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	13,880.68	13,880.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	366,864,632.59	366,864,632.59
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	4,780.62	4,780.62
应收申购款	8,122.74	-	-	-	-	-	-	-	29,670.04	37,792.78
资产总计	20,926,989.53	-	-	-	-	-	-	-	366,912,963.93	387,839,953.46
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	63,171.99	63,171.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	170,068.70	170,068.70
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	51,020.61	51,020.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	37,464.35	37,464.35
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	50,071.04	50,071.04
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	371,796.69	371,796.69
利率敏感度缺口	20,926,989.53	-	-	-	-	-	-	-	366,541,167.24	387,468,156.77
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	25,898,717.56	-	-	-	-	-	-	-	-	25,898,717.56

结算备付金	396,802.16	-	-	-	-	-	-	-	-	396,802.16
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	21,147.24	21,147.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	443,184,220.68	443,184,220.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,456,442.10	2,456,442.10
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	7,661.92	7,661.92
应收申购款	10,326.14	-	-	-	-	-	-	-	722,401.31	732,727.45
资产总计	26,305,845.86	-	-	-	-	-	-	-	446,391,873.25	472,697,719.11
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	32,580.39	32,580.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	218,813.84	218,813.84
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	65,644.18	65,644.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	332,051.40	332,051.40
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	50,092.16	50,092.16
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	699,181.97	699,181.97
利率敏感度缺口	26,305,845.86	-	-	-	-	-	-	-	445,692,691.28	471,998,537.14

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在 2011 年末及 2010 年末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，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%。于 2011 年 12 月 31 日，本基金面临的

整体其他价格风险列示如下:

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	366,864,632.59	94.68	443,184,220.68	93.90
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	366,864,632.59	94.68	443,184,220.68	93.90

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	+5%	19,244,058.56	23,350,631.11
	-5%	-19,244,058.56	-23,350,631.11

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 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	366,864,632.59	94.59
	其中: 股票	366,864,632.59	94.59
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	20,918,866.79	5.39
6	其他各项资产	56,454.08	0.01
7	合计	387,839,953.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,055,956.90	0.53
B	采掘业	39,634,944.20	10.23
C	制造业	122,036,733.94	31.50
C0	食品、饮料	26,866,230.07	6.93
C1	纺织、服装、皮毛	1,018,827.46	0.26
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,501,951.26	1.68
C5	电子	3,758,638.67	0.97
C6	金属、非金属	27,134,057.75	7.00
C7	机械、设备、仪表	40,936,060.18	10.57
C8	医药、生物制品	15,820,968.55	4.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,956,833.61	2.05
E	建筑业	9,576,882.83	2.47
F	交通运输、仓储业	11,317,082.67	2.92
G	信息技术业	12,957,366.90	3.34
H	批发和零售贸易	9,193,116.99	2.37
I	金融、保险业	113,554,164.55	29.31
J	房地产业	17,264,806.37	4.46
K	社会服务业	3,100,789.58	0.80
L	传播与文化产业	809,296.98	0.21

M	综合类	6,157,609.89	1.59
	合计	355,615,585.41	91.78

8.2.2 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	438,968.00	0.11
B	采掘业	385,113.00	0.10
C	制造业	7,066,699.18	1.82
C0	食品、饮料	366,080.00	0.09
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	1,035,066.00	0.27
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,354,490.00	0.61
C7	机械、设备、仪表	1,539,966.00	0.40
C8	医药、生物制品	1,625,177.18	0.42
C99	其他制造业	145,920.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,185,382.00	0.31
E	建筑业	299,832.00	0.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	485,090.00	0.13
H	批发和零售贸易	569,758.00	0.15
I	金融、保险业	246,318.00	0.06
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	571,887.00	0.15
	合计	11,249,047.18	2.90

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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所有股票投资明细

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	600036	招商银行	1,005,400	11,934,098.00	3.08

2	600016	民生银行	1,836,409	10,816,449.01	2.79
3	601318	中国平安	272,400	9,381,456.00	2.42
4	601398	工商银行	2,090,506	8,863,745.44	2.29
5	601328	交通银行	1,861,509	8,339,560.32	2.15
6	600000	浦发银行	909,935	7,725,348.15	1.99
7	601166	兴业银行	613,867	7,685,614.84	1.98
8	601088	中国神华	268,150	6,792,239.50	1.75
9	600519	贵州茅台	33,763	6,526,387.90	1.68
10	000002	万科A	787,021	5,879,046.87	1.52
11	600030	中信证券	559,925	5,436,871.75	1.40
12	000858	五粮液	154,310	5,061,368.00	1.31
13	600837	海通证券	668,936	4,956,815.76	1.28
14	601601	中国太保	255,560	4,909,307.60	1.27
15	601288	农业银行	1,663,101	4,357,324.62	1.12
16	600050	中国联通	689,327	3,612,073.48	0.93
17	601006	大秦铁路	483,478	3,606,745.88	0.93
18	601668	中国建筑	1,219,524	3,548,814.84	0.92
19	601169	北京银行	354,418	3,288,999.04	0.85
20	000001	深发展A	208,269	3,246,913.71	0.84
21	600015	华夏银行	278,416	3,126,611.68	0.81
22	600031	三一重工	246,953	3,096,790.62	0.80
23	600048	保利地产	290,166	2,901,660.00	0.75
24	002024	苏宁电器	341,282	2,880,420.08	0.74
25	601818	光大银行	986,127	2,840,045.76	0.73
26	002304	洋河股份	21,952	2,831,149.44	0.73
27	601857	中国石油	288,620	2,811,158.80	0.73
28	000651	格力电器	160,370	2,772,797.30	0.72
29	000157	中联重科	357,132	2,746,345.08	0.71
30	000063	中兴通讯	159,931	2,702,833.90	0.70
31	600887	伊利股份	129,973	2,655,348.39	0.69
32	600900	长江电力	402,443	2,559,537.48	0.66
33	600585	海螺水泥	162,592	2,544,564.80	0.66
34	601899	紫金矿业	642,438	2,454,113.16	0.63
35	600028	中国石化	338,540	2,430,717.20	0.63
36	600111	包钢稀土	59,075	2,222,992.25	0.57
37	601628	中国人寿	121,953	2,151,250.92	0.56
38	600104	上海汽车	150,285	2,125,029.90	0.55
39	000568	泸州老窖	56,677	2,114,052.10	0.55
40	600019	宝钢股份	427,128	2,071,570.80	0.53

41	000527	美的电器	165,092	2,020,726.08	0.52
42	600256	广汇股份	94,971	1,954,503.18	0.50
43	000338	潍柴动力	61,527	1,938,100.50	0.50
44	600999	招商证券	189,478	1,928,886.04	0.50
45	000983	西山煤电	128,099	1,870,245.40	0.48
46	000783	长江证券	258,227	1,846,323.05	0.48
47	601989	中国重工	357,753	1,828,117.83	0.47
48	000423	东阿阿胶	42,539	1,827,050.05	0.47
49	600383	金地集团	363,541	1,799,527.95	0.46
50	600795	国电电力	625,802	1,745,987.58	0.45
51	000895	双汇发展	24,635	1,723,218.25	0.44
52	601988	中国银行	566,806	1,655,073.52	0.43
53	000792	盐湖股份	51,725	1,653,648.25	0.43
54	600089	特变电工	214,276	1,645,639.68	0.42
55	600547	山东黄金	57,850	1,642,361.50	0.42
56	000069	华侨城 A	227,379	1,623,486.06	0.42
57	600406	国电南瑞	51,238	1,598,625.60	0.41
58	601699	潞安环能	74,833	1,583,466.28	0.41
59	601009	南京银行	168,966	1,568,004.48	0.40
60	000776	广发证券	72,188	1,515,948.00	0.39
61	601600	中国铝业	233,674	1,500,187.08	0.39
62	600348	阳泉煤业	97,766	1,484,087.88	0.38
63	600362	江西铜业	67,489	1,480,033.77	0.38
64	601168	西部矿业	154,994	1,452,293.78	0.37
65	600518	康美药业	125,132	1,403,981.04	0.36
66	600489	中金黄金	79,764	1,396,667.64	0.36
67	601766	中国南车	319,223	1,382,235.59	0.36
68	600739	辽宁成大	110,954	1,363,624.66	0.35
69	600276	恒瑞医药	45,698	1,345,349.12	0.35
70	601898	中煤能源	148,815	1,340,823.15	0.35
71	600068	葛洲坝	170,122	1,309,939.40	0.34
72	600875	东方电气	54,110	1,250,482.10	0.32
73	000709	河北钢铁	431,637	1,234,481.82	0.32
74	000538	云南白药	22,578	1,196,634.00	0.31
75	000402	金融街	196,886	1,191,160.30	0.31
76	600690	青岛海尔	130,984	1,169,687.12	0.30
77	601299	中国北车	269,922	1,147,168.50	0.30
78	600100	同方股份	129,228	1,137,206.40	0.29
79	600309	烟台万华	87,901	1,133,922.90	0.29

80	601788	光大证券	111,156	1,133,791.20	0.29
81	600123	兰花科创	27,864	1,083,352.32	0.28
82	600188	兖州煤业	48,131	1,077,653.09	0.28
83	601688	华泰证券	136,587	1,068,110.34	0.28
84	600642	申能股份	230,675	1,058,798.25	0.27
85	601390	中国中铁	416,895	1,050,575.40	0.27
86	601618	中国中冶	396,077	1,045,643.28	0.27
87	600660	福耀玻璃	130,239	1,044,516.78	0.27
88	600177	雅戈尔	108,617	1,018,827.46	0.26
89	601666	平煤股份	95,984	1,014,550.88	0.26
90	000100	TCL 集团	551,225	1,014,254.00	0.26
91	000024	招商地产	56,016	1,008,288.00	0.26
92	000630	铜陵有色	57,790	971,449.90	0.25
93	002202	金风科技	124,847	967,564.25	0.25
94	000012	南玻 A	106,770	967,336.20	0.25
95	000009	中国宝安	88,680	966,612.00	0.25
96	000060	中金岭南	117,405	966,243.15	0.25
97	600009	上海机场	78,333	958,795.92	0.25
98	000425	徐工机械	67,083	953,920.26	0.25
99	000937	冀中能源	56,413	951,123.18	0.25
100	600005	武钢股份	328,257	948,662.73	0.24
101	601186	中国铁建	250,277	948,549.83	0.24
102	600600	青岛啤酒	28,290	947,149.20	0.24
103	000878	云南铜业	57,578	927,005.80	0.24
104	000869	张裕 A	8,508	918,013.20	0.24
105	601117	中国化学	160,404	914,302.80	0.24
106	000623	吉林敖东	44,751	912,472.89	0.24
107	601998	中信银行	223,775	904,051.00	0.23
108	000039	中集集团	70,110	900,913.50	0.23
109	601958	金铂股份	78,699	895,594.62	0.23
110	600271	航天信息	45,045	894,593.70	0.23
111	600150	中国船舶	34,475	892,902.50	0.23
112	600143	金发科技	68,123	880,830.39	0.23
113	600535	天士力	20,993	880,446.42	0.23
114	601919	中国远洋	186,238	871,593.84	0.22
115	600583	海油工程	158,109	869,599.50	0.22
116	600415	小商品城	110,636	867,386.24	0.22
117	601111	中国国航	135,437	862,733.69	0.22
118	600010	宝钢股份	208,901	860,672.12	0.22

119	002142	宁波银行	93,784	859,061.44	0.22
120	002422	科伦药业	19,444	843,869.60	0.22
121	000401	冀东水泥	49,301	821,847.67	0.21
122	601727	上海电气	160,176	816,897.60	0.21
123	600029	南方航空	171,286	811,895.64	0.21
124	601333	广深铁路	229,768	808,783.36	0.21
125	600694	大商股份	23,880	794,726.40	0.21
126	600196	复星医药	92,801	792,520.54	0.20
127	600655	豫园商城	93,486	783,412.68	0.20
128	000422	湖北宜化	44,097	778,312.05	0.20
129	600741	华域汽车	84,008	777,914.08	0.20
130	600058	五矿发展	34,860	763,782.60	0.20
131	000933	神火股份	81,953	757,245.72	0.20
132	600085	同仁堂	52,931	742,621.93	0.19
133	000768	西飞国际	100,718	731,212.68	0.19
134	002073	软控股份	48,285	730,552.05	0.19
135	600881	亚泰集团	154,045	730,173.30	0.19
136	600115	东方航空	189,812	721,285.60	0.19
137	000876	新希望	42,383	709,915.25	0.18
138	601717	郑煤机	28,426	706,954.62	0.18
139	600066	宇通客车	29,588	700,052.08	0.18
140	601808	中海油服	48,139	697,534.11	0.18
141	600166	福田汽车	120,037	697,414.97	0.18
142	600153	建发股份	109,160	696,440.80	0.18
143	600497	驰宏锌锗	53,257	696,068.99	0.18
144	002415	海康威视	16,179	695,697.00	0.18
145	000969	安泰科技	41,898	693,830.88	0.18
146	601607	上海医药	62,538	692,921.04	0.18
147	000825	太钢不锈	185,246	690,967.58	0.18
148	600132	重庆啤酒	24,282	690,822.90	0.18
149	600125	铁龙物流	74,299	689,494.72	0.18
150	600832	东方明珠	129,528	683,907.84	0.18
151	000898	鞍钢股份	149,978	682,399.90	0.18
152	000728	国元证券	79,754	677,909.00	0.17
153	600267	海正药业	21,335	677,812.95	0.17
154	601106	中国一重	212,620	676,131.60	0.17
155	600320	振华重工	143,591	674,877.70	0.17
156	600809	山西汾酒	10,560	666,758.40	0.17
157	000729	燕京啤酒	49,199	663,694.51	0.17

158	601001	大同煤业	54,430	661,868.80	0.17
159	600549	厦门钨业	22,179	658,050.93	0.17
160	000960	锡业股份	36,851	656,316.31	0.17
161	000758	中色股份	37,399	644,384.77	0.17
162	600839	四川长虹	300,247	642,528.58	0.17
163	000528	柳 工	54,891	640,577.97	0.17
164	600804	鹏博士	108,824	632,267.44	0.16
165	600550	天威保变	55,814	624,000.52	0.16
166	002155	辰州矿业	30,989	621,949.23	0.16
167	600582	天地科技	32,898	608,613.00	0.16
168	600859	王府井	18,812	604,053.32	0.16
169	600893	航空动力	44,293	601,941.87	0.16
170	600219	南山铝业	94,350	597,235.50	0.15
171	600588	用友软件	33,168	597,024.00	0.15
172	600811	东方集团	108,412	595,181.88	0.15
173	002007	华兰生物	23,424	585,834.24	0.15
174	600779	水井坊	27,804	585,552.24	0.15
175	000800	一汽轿车	66,160	585,516.00	0.15
176	600118	中国卫星	28,662	584,704.80	0.15
177	600376	首开股份	60,760	582,688.40	0.15
178	600316	洪都航空	34,972	582,283.80	0.15
179	002001	新 和 成	29,511	580,186.26	0.15
180	000625	长安汽车	152,884	577,901.52	0.15
181	600664	哈药股份	78,763	577,332.79	0.15
182	002106	莱宝高科	34,105	571,599.80	0.15
183	002069	獐 子 岛	23,088	567,041.28	0.15
184	601101	昊华能源	32,521	563,914.14	0.15
185	601888	中国国旅	21,464	563,000.72	0.15
186	600649	城投控股	93,420	562,388.40	0.15
187	002092	中泰化学	74,985	561,637.65	0.14
188	600997	开滦股份	50,190	559,116.60	0.14
189	600331	宏达股份	67,090	558,188.80	0.14
190	000061	农 产 品	49,932	556,741.80	0.14
191	600395	盘江股份	26,912	555,732.80	0.14
192	600108	亚盛集团	112,977	553,587.30	0.14
193	000999	华润三九	31,835	550,745.50	0.14
194	002385	大北农	16,219	527,117.50	0.14
195	601179	中国西电	141,693	524,264.10	0.14
196	600208	新湖中宝	151,483	518,071.86	0.13

197	600703	三安光电	46,961	513,283.73	0.13
198	000839	中信国安	76,486	511,691.34	0.13
199	601558	华锐风电	32,622	510,208.08	0.13
200	000562	宏源证券	47,520	509,414.40	0.13
201	601918	国投新集	45,132	502,319.16	0.13
202	600598	北大荒	57,812	500,651.92	0.13
203	000778	新兴铸管	77,923	497,927.97	0.13
204	601018	宁波港	208,133	497,437.87	0.13
205	600635	大众公用	106,985	491,061.15	0.13
206	600718	东软集团	59,884	487,455.76	0.13
207	600808	马钢股份	194,076	481,308.48	0.12
208	600352	浙江龙盛	83,570	478,020.40	0.12
209	601866	中海集运	193,469	470,129.67	0.12
210	601158	重庆水务	78,050	469,080.50	0.12
211	600970	中材国际	29,629	466,953.04	0.12
212	600008	首创股份	89,432	465,046.40	0.12
213	601369	陕鼓动力	39,887	457,105.02	0.12
214	600516	方大炭素	51,996	455,484.96	0.12
215	600169	太原重工	78,829	448,537.01	0.12
216	600266	北京城建	36,147	447,861.33	0.12
217	000680	山推股份	49,378	443,414.44	0.11
218	600508	上海能源	23,504	440,229.92	0.11
219	600418	江淮汽车	73,344	437,130.24	0.11
220	600216	浙江医药	21,955	436,684.95	0.11
221	600062	双鹤药业	27,888	435,052.80	0.11
222	601118	海南橡胶	63,923	434,676.40	0.11
223	002128	露天煤业	32,359	433,610.60	0.11
224	600812	华北制药	66,900	433,512.00	0.11
225	600879	航天电子	52,752	433,093.92	0.11
226	600221	海南航空	96,118	430,608.64	0.11
227	600895	张江高科	62,956	427,471.24	0.11
228	002310	东方园林	4,887	423,947.25	0.11
229	600037	歌华有线	51,726	413,290.74	0.11
230	600432	吉恩镍业	32,903	405,693.99	0.10
231	600863	内蒙华电	48,323	401,080.90	0.10
232	002146	荣盛发展	45,457	400,021.60	0.10
233	601098	中南传媒	43,806	396,006.24	0.10
234	000027	深圳能源	64,464	393,230.40	0.10
235	600546	山煤国际	16,118	390,861.50	0.10

236	601933	永辉超市	12,487	376,483.05	0.10
237	600500	中化国际	58,440	373,431.60	0.10
238	000059	辽通化工	48,802	370,895.20	0.10
239	000807	云铝股份	75,083	369,408.36	0.10
240	000559	万向钱潮	64,768	366,586.88	0.09
241	600595	中孚实业	61,581	355,938.18	0.09
242	000718	苏宁环球	66,446	348,177.04	0.09
243	600674	川投能源	30,340	339,808.00	0.09
244	000780	平庄能源	32,986	339,755.80	0.09
245	600161	天坛生物	20,955	336,956.40	0.09
246	600096	云天化	22,558	335,663.04	0.09
247	601377	兴业证券	35,773	332,688.90	0.09
248	600971	恒源煤电	24,391	322,692.93	0.08
249	601718	际华集团	94,075	321,736.50	0.08
250	002399	海普瑞	13,012	321,396.40	0.08
251	600183	生益科技	44,498	321,275.56	0.08
252	600456	宝钛股份	17,491	318,686.02	0.08
253	002122	天马股份	48,294	312,945.12	0.08
254	002405	四维图新	15,563	312,505.04	0.08
255	002493	荣盛石化	18,082	309,021.38	0.08
256	600026	中海发展	51,429	304,459.68	0.08
257	000968	煤气化	20,885	297,611.25	0.08
258	600528	中铁二局	59,318	292,437.74	0.08
259	600428	中远航运	68,718	283,118.16	0.07
260	600151	航天机电	38,923	280,245.60	0.07
261	000021	长城开发	53,630	275,121.90	0.07
262	002500	山西证券	39,022	252,472.34	0.07
263	600170	上海建工	28,205	250,178.35	0.06
264	600307	酒钢宏兴	66,527	250,141.52	0.06
265	600380	健康元	41,893	247,587.63	0.06
266	600737	中粮屯河	40,879	245,682.79	0.06
267	600109	国金证券	24,397	242,018.24	0.06
268	000961	中南建设	28,485	239,843.70	0.06
269	002244	滨江集团	32,976	233,799.84	0.06
270	600481	双良节能	26,345	194,426.10	0.05
271	601268	二重重装	27,480	194,008.80	0.05
272	002498	汉缆股份	11,464	188,009.60	0.05
273	601519	大智慧	11,301	122,954.88	0.03

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所有股票投资明细

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	000629	攀钢钒钛	232,700	1,461,356.00	0.38
2	000581	威孚高科	29,400	1,055,166.00	0.27
3	601991	大唐发电	162,500	838,500.00	0.22
4	600252	中恒集团	71,000	754,020.00	0.19
5	002038	双鹭药业	18,500	607,725.00	0.16
6	600160	巨化股份	28,700	575,435.00	0.15
7	600770	综艺股份	35,900	571,887.00	0.15
8	600498	烽火通信	17,900	485,090.00	0.13
9	600372	中航电子	20,000	484,800.00	0.13
10	002299	圣农发展	29,600	438,968.00	0.11
11	601992	金隅股份	50,600	425,546.00	0.11
12	600259	广晟有色	10,100	385,113.00	0.10
13	600873	梅花集团	44,000	366,080.00	0.09
14	600098	广州控股	50,200	346,882.00	0.09
15	600783	鲁信创投	18,100	310,958.00	0.08
16	002344	海宁皮城	13,600	307,768.00	0.08
17	002431	棕榈园林	12,400	299,832.00	0.08
18	601233	桐昆股份	23,500	275,655.00	0.07
19	002603	以岭药业	6,862	263,432.18	0.07
20	601258	庞大集团	42,600	261,990.00	0.07
21	601099	太平洋	36,600	246,318.00	0.06
22	601216	内蒙君正	10,400	183,976.00	0.05
23	002378	章源钨业	6,900	156,630.00	0.04
24	002594	比亚迪	6,400	145,920.00	0.04

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	5,437,866.08	1.15
2	600036	招商银行	5,065,293.43	1.07
3	600000	浦发银行	4,656,344.37	0.99

4	600837	海通证券	4,426,559.01	0.94
5	000776	广发证券	4,369,698.14	0.93
6	600016	民生银行	3,816,704.00	0.81
7	601398	工商银行	3,811,429.08	0.81
8	601328	交通银行	3,683,493.17	0.78
9	601166	兴业银行	3,660,768.12	0.78
10	600887	伊利股份	3,569,477.27	0.76
11	601818	光大银行	3,427,257.00	0.73
12	601088	中国神华	3,237,283.89	0.69
13	601288	农业银行	2,980,265.00	0.63
14	000002	万科A	2,828,195.00	0.60
15	600030	中信证券	2,770,026.00	0.59
16	600406	国电南瑞	2,755,107.50	0.58
17	002304	洋河股份	2,591,638.14	0.55
18	600585	海螺水泥	2,574,700.43	0.55
19	000157	中联重科	2,564,206.00	0.54
20	600276	恒瑞医药	2,478,616.71	0.53

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	5,671,439.45	1.20
2	600036	招商银行	5,293,275.65	1.12
3	600016	民生银行	4,294,291.27	0.91
4	601398	工商银行	4,092,319.73	0.87
5	601328	交通银行	3,906,548.07	0.83
6	601166	兴业银行	3,789,267.14	0.80
7	601088	中国神华	3,394,899.44	0.72
8	600000	浦发银行	3,334,664.54	0.71
9	000002	万科A	3,051,521.74	0.65
10	600030	中信证券	2,846,316.60	0.60
11	600519	贵州茅台	2,478,322.56	0.53
12	600900	长江电力	2,371,984.77	0.50
13	000063	中兴通讯	2,316,816.49	0.49
14	601601	中国太保	2,306,753.98	0.49

15	600018	上港集团	2,294,126.98	0.49
16	600132	重庆啤酒	2,267,155.28	0.48
17	000858	五粮液	2,238,286.72	0.47
18	000069	华侨城 A	1,921,048.25	0.41
19	601006	大秦铁路	1,912,800.92	0.41
20	600585	海螺水泥	1,891,852.09	0.40

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	335,820,452.26
卖出股票收入（成交）总额	286,740,605.34

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 8.5 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。

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

注：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

注：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

注：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	13,880.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	4,780.62
5	应收申购款	37,792.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,454.08

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末积极投资前五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		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比 例	持有份额	占总份 额比 例
16,633	32,105.85	110,935,562.57	20.77%	423,081,067.17	79.23%

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	邵云娟	5,039,314.00	25.13%
2	红塔证券股份有限公司	2,003,355.00	9.99%
3	张元中	331,400.00	1.65%
4	余红旗	300,000.00	1.50%

5	黄国序	300,000.00	1.50%
6	刘沿	246,939.00	1.23%
7	郭晓宇	246,033.00	1.23%
8	王碧玲	207,504.00	1.03%
9	李磊	206,200.00	1.03%
10	钟景春	198,166.00	0.99%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

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	118,247.73	0.02%

§ 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	495,740,616.48
本报告期基金总申购份额	238,745,787.83
减：本报告期基金总赎回份额	200,469,774.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	534,016,629.74

§ 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，经本基金管理人董事会批准，魏瑛女士自2011年1月7日起不再担任本基金管理人公司副总经理职务；

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，经本基金管理人董事会批准，石松鹰先生自2011年1月31日起不再担任本基金管理人公司副总经理职务；

11.2.1.3 2011年5月17日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人

董事会批准并经中国证监会核准，自 2011 年 5 月 13 日起增聘陆文俊先生为本基金管理人公司副总经理；

11.2.1.4 2011 年 12 月 26 日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会批准并经中国证监会核准，自 2011 年 12 月 23 日起增聘封树标先生为本基金管理人公司副总经理；

11.2.1.5 2012 年 2 月 16 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，彭越先生自 2012 年 2 月 14 日起不再担任本基金管理人公司董事长职务，本基金管理人聘任王珠林先生为公司董事长，同时在中国证监会核准王珠林先生的任职资格和任职事项前，本基金管理人董事会决定由公司董事、总经理王立新先生代为履行董事长职责，代为履行职责的时间不超过 90 日；

11.2.1.6 2012 年 2 月 23 日，本基金管理人发布关于公司董事变更的公告，经本基金管理人股东会审议通过，增选钱龙海先生、周晓冬先生以及高歌女士为公司董事，其中高歌女士为公司独立董事，彭越先生、李兆会先生以及汪贻祥先生不再担任公司董事职务。

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；

11.2.2.3 本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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 3 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		应支付该券商的佣金		备注
		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	
安信证券股份有限公司	3	84,536,417.23	13.64%	71,856.28	13.81%	-
国都证券有限责任公司	2	72,941,966.70	11.77%	60,253.11	11.58%	新增两个交易单元
长江证券股份有限公司	2	68,754,714.47	11.09%	57,574.85	11.07%	-
上海证券有限责任公司	1	56,652,009.93	9.14%	48,154.22	9.26%	-
中信证券股份有限公司	3	42,518,086.63	6.86%	34,546.32	6.64%	-
光大证券股份有限公司	2	38,022,694.58	6.13%	32,319.16	6.21%	-
中国国际金融有限公司	2	36,702,025.42	5.92%	30,380.64	5.84%	-
西部证券股份有限公司	1	29,295,267.01	4.73%	24,900.91	4.79%	-
齐鲁证券有限公司	1	26,754,208.19	4.32%	22,741.36	4.37%	-
广发证券股份有限公司	1	24,473,984.24	3.95%	20,802.91	4.00%	-
中国银河证券股份有限公司	1	23,997,214.92	3.87%	20,397.92	3.92%	-
方正证券有限责任公司	1	22,586,170.45	3.64%	19,198.10	3.69%	-
中银国际证券有限责任公司	3	16,206,539.09	2.61%	13,217.90	2.54%	-
中国民族证券有限责任公司	1	15,298,319.86	2.47%	13,003.67	2.50%	-
兴业证券股份有限公司	3	11,263,751.62	1.82%	9,151.98	1.76%	-

公司						
华融证券股份有限 公司	1	9,767,761.30	1.58%	8,302.92	1.60%	新增一个交 易单元
国信证券股份有限 公司	3	9,521,091.89	1.54%	7,735.82	1.49%	新增两个交 易单元
华创证券有限责任 公司	2	9,272,951.62	1.50%	7,862.07	1.51%	-
华宝证券有限责任 公司	1	8,660,794.63	1.40%	7,361.94	1.42%	-
东方证券股份有限 公司	2	5,340,683.49	0.86%	4,339.30	0.83%	-
国金证券股份有限 公司	2	4,755,137.93	0.77%	4,042.15	0.78%	-
第一创业证券有限 责任	2	1,643,483.25	0.27%	1,397.11	0.27%	-
宏源证券股份有限 公司	2	807,605.73	0.13%	656.16	0.13%	-
华泰联合证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	新增一个交 易单元
山西证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责 任公	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限 责任	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

长城证券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份 有限	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信万通证券有限 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等。

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

注：本基金本报告期内未通过交易单元进行债券、债券回购及权证交易。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于旗下部分基金参加中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定期定额投资业务费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 31 日
2	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行网上银行和定期定额投资基金申购费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 31 日
3	《银华基金管理有限公司关于旗下基金场外代销机构变更的提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 27 日
4	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2011 年 12 月 26 日

		http://www.yhfund.com.cn	
5	《银华基金管理有限公司关于银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 解聘基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 7 日
6	《银华基金管理有限公司关于开通机构版网上直销业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 6 日
7	《银华基金管理有限公司关于面向使用兴业银行借记卡的投资者开通网上直销智能投资等业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 12 月 5 日
8	《关于增加日信证券为旗下部分基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 11 月 30 日
9	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书及摘要 (2011 年第 2 号)》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 11 月 28 日
10	《银华基金管理有限公司关于撤销上海分公司的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 11 月 26 日
11	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券开通转换业务及参加费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 10 月 28 日
12	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年第 3 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 10 月 25 日
13	《银华基金管理有限公司关于增加国开证券为旗下部分基金代销机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 10 月 11 日
14	《银华基金管理有限公司关于银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 增聘基金经理的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 9 月 28 日
15	《银华基金管理有限公司关于调整中国农业银行借记卡网上直销申购费率的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 9 月 20 日
16	《银华基金管理有限公司关于面向使用天天盈账户的投资者开通网上直销智能投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 9 月 15 日
17	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 8 月 31 日
18	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 8 月 26 日

19	《银华基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 8 月 12 日
20	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在长江证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 8 月 5 日
21	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 7 月 27 日
22	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2011 年第 2 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 7 月 21 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加厦门证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 7 月 8 日
24	《银华基金管理有限公司 2011 年 6 月 30 日基金净值公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 7 月 1 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 6 月 29 日
26	《银华基金管理有限公司关于提醒投资者防范非法证券活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 6 月 16 日
27	《银华基金管理有限公司关于增加英大证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 6 月 8 日
28	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书及摘要(2011 年第 1 号)》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 5 月 28 日
29	《银华基金管理有限公司关于增加浙商证券为旗下部分基金代销及定期定额投资业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 5 月 26 日
30	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 5 月 17 日
31	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 5 月 6 日
32	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 28 日
33	《关于增加华融证券为旗下部分基	《中国证券报》、《上海证券	2011 年 4 月 27 日

	金代销、定期定额投资及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	
34	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2011 年第 1 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 20 日
35	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在西南证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 12 日
36	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 4 月 1 日
37	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人网上银行费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 31 日
38	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2010 年年度报告及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 30 日
39	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券网上费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 21 日
40	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 15 日
41	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 8 日
42	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券网上申购业务费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 3 月 3 日
43	《银华基金管理有限公司关于对公司旗下基金持有的停牌股票进行估值方法调整的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 22 日
44	《银华基金管理有限公司关于增加重庆银行为旗下基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 16 日
45	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海农商银行开通代销等业务及参加费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 9 日
46	《银华基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 2 月 1 日

47	《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2010 年第 4 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 22 日
48	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在天相投顾开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 22 日
49	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在德邦证券开通定期定额投资业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 17 日
50	《银华基金管理有限公司关于推出基金手机交易与查询业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
51	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通基金赎回转认/申购业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
52	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通定期定额赎回业务和定期定额转换业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
53	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通现金宝业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
54	《银华基金管理有限公司关于基金网上直销系统开通定期不定额申购业务的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 10 日
55	《银华基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 8 日
56	《银华基金管理有限公司 2010 年 12 月 31 日基金净值公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站 http://www.yhfund.com.cn	2011 年 1 月 4 日

§ 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 2011 年 10 月 28 日，本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

12.2.2 2012 年 1 月 16 日，本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会批准银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）设立的文件
- 13.1.2 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 13.1.3 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 13.1.4 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 13.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司
2012 年 3 月 27 日