

## 银华沪深300指数证券投资基金(LOF)

[2010] 年度报告摘要

基金管理人的董事、监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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并报中国证监会备案。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，于2011年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人诚以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金资产，但不保证本基金一定盈利。

本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摘要。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利。

本基金年度报告经审计，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称 银华沪深300指数(LOF)

基金主代码 161811

上市交易场所 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 银华基金管理有限公司

报告期基金份额总额 495,740,616.48份

基金合同存续期 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2009年10月30日

## 2.2 基金产品说明

本基金运用指数化投资方法，通过严格的的投资流程约束

和数据化风险管理手段，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%。

本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在沪深300指数

中的组成及与其权重构造建股票投资组合，以求最大限度地

模拟标的指数的表现，并根据标的指数成份股及其

权重变动而进行相应的调整。

本基金将投资于股票指数期货以及与标的指数构成成份股相关的金融产品，以使本基金的指数化投资组合更紧密地跟踪标的指数。

本基金主要投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合

比例不大于基金净资产的90%，现金或者到期日在一年

以内的政府债券不低于基金净资产的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

姓名 陈立军 严东

信息披露负责人 联系电话 (010)58163000 (010)67950003

电子邮箱 yh@yhfund.com.cn yinding.zh@ccb.com

客户服务电话 4006783333,(010)85186558 (010)67950996

传真 (010)58163027 (010)66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.yhfund.com.cn

基金年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人办公地址

## 3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2010年 2009年10月14日(基金合同生效日)至2009年12月31日

本期已实现收益 -4,881,124.48 2,527,549.83

本期利润 -64,541,268.79 43,189,093.93

加权平均基金份额本期利润 -0.1089 0.0753

本期平均净值增长率 -11.61% 7.18%

本期期末净值增长率 -11.83% 8.00%

3.1.2 期末数据和指标 2010年末 2009年末

本期可分配利润 -23,742,079.34 2,575,937.86

期末可供分配基金份额利润 -0.0479 0.0044

期末基金净值 471,998,337.14 627,312,360.40

3.1.3 累计期指数据 2010年末 2009年末

基金份额累计净值增长率 -4.80% 8.00%

3.2.1 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.3 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.4 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.5 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.6 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.7 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.8 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%

注：由于本基金的资产分为沪深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净资产的95%，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)。

3.2.9 基金合同生效以来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

份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

份额净值增长率 业绩比较基准收益率差额 (%)

增长率为正数时 ①-③ ②-④

过去三个月 6.01% 1.67% 6.28% 1.68% -0.27% -0.01%

过去六个月 20.66% 20.94% 1.47% -0.28% 0.00%

过去一年 -11.85% 1.50% -11.78% 1.50% -0.07% 0.00%

自基金运作以来 -4.80% 1.47% -1.89% 1.52% -2.91% -0.05%