

# 银华深证 100 指数分级证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 24 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。本半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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	38
7.7 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.....	38
7.8 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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>44</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华深证 100 指数分级证券投资基金		
基金简称	银华深证 100 指数分级		
基金主代码	161812		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 5 月 7 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	10,855,352,827.96 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	2010 年 06 月 07 日		
下属分级基金的基金简称	银华稳进	银华锐进	银华 100
下属分级基金的交易代码	150018	150019	161812
报告期末下属分级基金份额总额	4,723,794,580.00 份	4,723,794,580.00 份	1,407,763,667.96 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，力争将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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现有效跟踪深证 100 指数的有效跟踪，分享中国经济的持续、稳定增长的成果，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 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。</p> <p>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深证 100 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。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，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%）。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。
风险收益特征	本基金为完全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，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，银华稳进份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华锐进份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的基金简称	银华稳进	银华锐进	银华 100
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

## 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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	关悦
	联系电话	(010) 58163000	(010) 58560666
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	Guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95568
传真		(010) 58163027	(010) 58560794
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100738	100031
法定代表人		王立新(代)	董文标

## 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日 )</b>
本期已实现收益	-373, 275, 559. 14
本期利润	352, 840, 807. 65
加权平均基金份额本期利润	0. 0395
本期加权平均净值利润率	4. 50%
本期基金份额净值增长率	5. 86%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末( 2012 年 6 月 30 日 )</b>
期末可供分配利润	-1, 103, 861, 099. 95
期末可供分配基金份额利润	-0. 1017
期末基金资产净值	9, 220, 700, 626. 82
期末基金份额净值	0. 849
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末( 2012 年 6 月 30 日 )</b>
基金份额累计净值增长率	-10. 77%

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：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

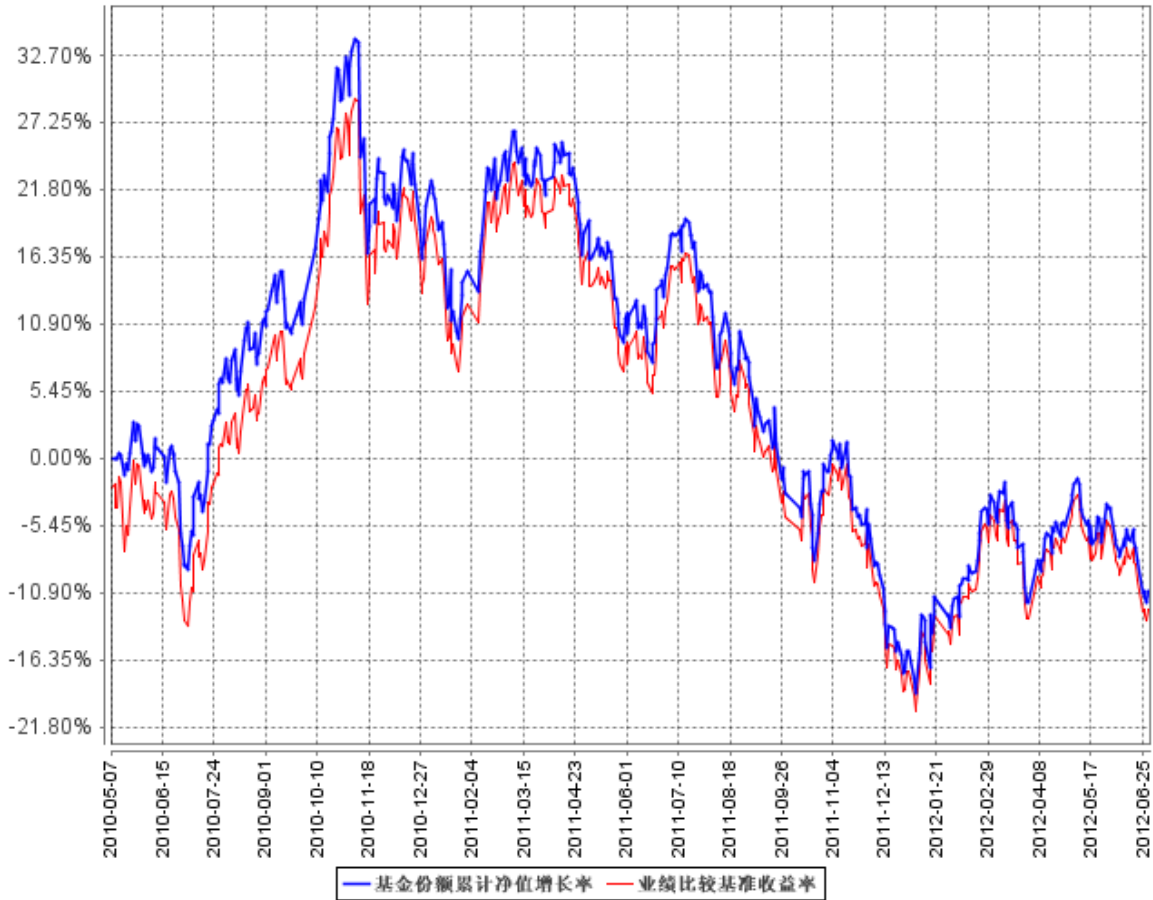
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7. 01%	1. 08%	-7. 20%	1. 11%	0. 19%	-0. 03%
过去三个月	0. 95%	1. 19%	0. 81%	1. 21%	0. 14%	-0. 02%
过去六个月	5. 86%	1. 42%	6. 03%	1. 44%	-0. 17%	-0. 02%
过去一年	-22. 29%	1. 39%	-21. 84%	1. 41%	-0. 45%	-0. 02%
自基金合同生效日起至 今	-10. 77%	1. 43%	-12. 24%	1. 49%	1. 47%	-0. 06%

注：本基金的业绩比较基准为 95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。由于本基金的投资标的为深证 100 价格指数，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%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。



### 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的规定：投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，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%）。

## § 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)设立的全国性资产管理公司。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%、第一创业证券股份有限公司 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 2012 年 6 月 30 日,本基金管理人管理着 23 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、银华中小盘精选股票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5月7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,2010年6月21日至2011年12月6日期间兼任银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2010年8月5日至2012年3月27日期间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。
王飞先生	本基金的基金经理助理	2011年7月25日	-	3年	硕士学位。毕业于北京航空航天大学。2009年7月至2012年8月就职于银华基金管理有限公

					司，曾担任公司量化投资部研究员职务。具有从业资格。国籍：中国。
--	--	--	--	--	---------------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

3、王飞先生已于 2012 年 8 月 16 日离职，并自该日起不再担任本基金基金经理助理职务。

## 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、《银华深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券

当日成交量的 5%的情况有 13 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

#### 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，我们积极改进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 0.849 元，本报告期份额净值增长率为 5.86%，同期业绩比较基准收益率为 6.03%。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

回顾 2012 年上半年，尽管政策在微调的前提下持续发力，但经济并未出现年初市场一致预期的探底后企稳，由此导致市场在经过了一季度的反弹后继续走弱；然而结构上却出现了较大的分化，一方面是以房地产为代表的周期板块在政策放松、销量上升的背景下持续走强，另一方面则是以食品饮料为代表的非周期板块由业绩推动上涨。

展望 2012 年下半年，经济增速与通胀会继续出现回落，但经济调整的速度将更为温和，并在下半年出现企稳回升信号。相对上半年，流动性的边际效用将逐渐递减，市场中期的主要矛盾仍在于经济能否如期复苏。地产能否继续回暖及对应的政策、流动性放松是否能持续，欧债危机是否继续恶化并波及全球风险资产，都是我们需要密切关注的变量。结构方面，我们认为确定性盈利增长和确定性主题的板块存在更大的机会。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核

部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干), 负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定, 本基金(包括银华 100 份额、银华稳进份额、银华锐进份额)不进行收益分配。

## § 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

中国民生银行根据《银华深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和《银华深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》, 托管银华深证 100 指数分级证券投资基金(以下简称“银华深证 100 指数分级”)。

本报告期, 中国民生银行在银华深证 100 指数分级的托管过程中, 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, 依法安全保管了基金财产, 按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告, 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, 按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定, 本托管人对基金管理人——银华基金管理有限责任公司在银华深证 100 指数分级投资运作方面进行了监督, 对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期, 基金管理人——银华基金管理有限责任公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

根据本基金基金合同的约定, 本基金(包括银华 100 份额、银华稳进份额、银华锐进份额)不进行收益分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由银华深证 100 指数分级的基金管理人——银华基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华深证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	654,469,257.68	444,946,515.39
结算备付金		3,702,136.29	3,554,782.40
存出保证金		1,750,000.00	1,055,405.02
交易性金融资产	6.4.7.2	8,646,642,030.76	7,076,374,061.06
其中：股票投资		8,646,642,030.76	7,076,374,061.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	149,926.53	118,706.39
应收股利		-	-
应收申购款		63,666,520.06	175,168.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,370,379,871.32	7,526,224,639.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		135,635,790.31	17,441,241.20
应付管理人报酬		7,494,443.76	6,188,279.59

应付托管费		1,498,888.76	1,237,655.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,660,196.16	2,120,466.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,389,925.51	1,415,434.38
负债合计		149,679,244.50	28,403,077.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,324,561,726.77	8,897,231,570.50
未分配利润	6.4.7.10	-1,103,861,099.95	-1,399,410,008.43
所有者权益合计		9,220,700,626.82	7,497,821,562.07
负债和所有者权益总计		9,370,379,871.32	7,526,224,639.22

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，银华 100 份额净值为人民币 0.849 元，银华稳进份额净值为人民币 1.032 元，银华锐进份额净值为人民币 0.666 元；基金份额总额为 10,855,352,827.96 份，其中银华 100 份额为 1,407,763,667.96 份，银华稳进份额为 4,723,794,580.00 份，银华锐进份额为 4,723,794,580.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华深证 100 指数分级证券投资基金  
本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		407,202,468.31	-189,558,675.92
1.利息收入		2,001,621.64	1,224,529.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,001,621.64	1,224,529.65
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）		-323,771,980.25	27,042,024.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-374,898,613.29	1,675,337.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	51,126,633.04	25,366,687.39
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	726,116,366.79	-219,206,094.16



“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	2,856,460.13	1,380,864.20
<b>二、费用</b>		54,361,660.66	38,641,900.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,915,239.12	26,255,333.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,783,047.84	5,251,066.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,412,890.10	6,910,678.20
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	250,483.60	224,822.65
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		352,840,807.65	-228,200,576.64
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		352,840,807.65	-228,200,576.64

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 银华深证 100 指数分级证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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)	8,897,231,570.50	-1,399,410,008.43	7,497,821,562.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	352,840,807.65	352,840,807.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,427,330,156.27	-57,291,899.17	1,370,038,257.10
其中: 1.基金申购款	4,160,586,504.55	-317,889,908.72	3,842,696,595.83
2. 基金赎回款	-2,733,256,348.28	260,598,009.55	-2,472,658,338.73
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）	10,324,561,726.77	-1,103,861,099.95	9,220,700,626.82
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	4,229,615,852.27	866,752,806.02	5,096,368,658.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-228,200,576.64	-228,200,576.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,056,045,628.15	142,052,856.24	1,198,098,484.39
其中：1.基金申购款	1,982,498,168.86	329,363,195.86	2,311,861,364.72
2.基金赎回款	-926,452,540.71	-187,310,339.62	-1,113,762,880.33
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）	5,285,661,480.42	780,605,085.62	6,066,266,566.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新  
基金管理人负责人

杨清  
主管会计工作负责人

龚飒  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华深证 100 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]302 号文《关于核准银华深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理有限公司于 2010 年 4 月 1 日至 2010 年 4 月 30 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2010) 验字第 60468687\_A01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2010 年 5 月 7 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,203,273,458.85 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 614,907.10 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,203,888,365.95 元，折合 2,203,888,365.95 份基金份额。根据

《基金合同》的约定，场外认购的全部份额确认为银华 100 份额；场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为银华锐进份额和银华稳进份额。其中场外认购的基金份额确认为 1,748,978,674.95 份银华 100 份额（含募集期利息结转的份额）；场内认购的基金份额按 1:1 的比例确认为 227,454,845.00 份银华锐进份额和 227,454,845.00 份银华稳进份额，产生的尾差份额 1.00 份根据《基金合同》约定归入基金资产。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华深证 100 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“银华 100 份额”）、银华深证 100 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“银华稳进份额”）与银华深证 100 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“银华锐进份额”）。其中，银华稳进份额、银华锐进份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

在银华稳进份额、银华 100 份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。银华稳进份额和银华锐进份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对银华稳进份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份银华 100 份额将按 1 份银华稳进份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于银华稳进份额期末的约定应得收益，即银华稳进份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内银华 100 份额分配给银华稳进份额持有人。银华 100 份额持有人持有的每 2 份银华 100 份额将按 1 份银华稳进份额获得新增银华 100 份额的分配。持有场外银华 100 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华 100 份额的分配；持有场内银华 100 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华 100 份额的分配。经过上述份额折算，银华稳进份额和银华 100 份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对银华稳进份额和银华 100 份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同的规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当银华 100 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当银华锐进份额的基金份额净值达到 0.250 元。当银华 100 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对银华稳进份额、银华锐进份额和银华 100 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华稳进份额和银华锐进份额的比例为 1:1，份额折算后银华稳进份额、银华锐进份额和银华 100 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当银华锐进份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对银华稳进份额、银华锐进份额和银华 100 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华稳进份额和银华锐进份额的比例为 1:1，份额折算后银华 100 份额、银华稳进份额和银华锐进份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

银华 100 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。银华稳进份额与银华锐进份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证 100 指数的成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-10%（其中权证资产占基金资产比例为 0-3%，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%）。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为： $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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[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。

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。

##### (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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	654,469,257.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	654,469,257.68

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,904,875,725.31	8,646,642,030.76	-1,258,233,694.55
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	9,904,875,725.31	8,646,642,030.76	-1,258,233,694.55

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	138,455.17
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	1,666.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9,805.36
其他	-
合计	149,926.53

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,660,196.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,660,196.16

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	406,686.09
预提费用	233,239.42
合计	2,389,925.51



### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,023,233,249.12	8,897,231,570.50
本期申购	25,858,063.40	25,497,822.10
本期赎回(以“-”号填列)	-315,551.50	-311,155.39
2012 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	9,048,775,761.02	8,922,418,237.21
基金拆分/份额折算变动份额	332,635,198.67	-
本期申购	4,347,419,910.29	4,135,088,682.45
本期赎回(以“-”号填列)	-2,873,478,042.02	-2,732,945,192.89
本期末	10,855,352,827.96	10,324,561,726.77

注：（1）根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2012 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对银华深证 100 份额的场外份额、场内份额以及银华稳进份额实施定期份额折算。

（2）根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回银华 100 份额，银华稳进份额和银华锐进份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露银华稳进份额和银华锐进份额的情况。

### 6.4.7.10 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	290,431,199.00	-1,689,841,207.43	-1,399,410,008.43
本期利润	-373,275,559.14	726,116,366.79	352,840,807.65
本期基金份额交易产生的变动数	-27,199,130.76	-30,092,768.41	-57,291,899.17
其中：基金申购款	-9,045,997.59	-308,843,911.13	-317,889,908.72
基金赎回款	-18,153,133.17	278,751,142.72	260,598,009.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-110,043,490.90	-993,817,609.05	-1,103,861,099.95

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	37,076.84
其他	33,646.25
合计	2,001,621.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,066,833,821.88
减：卖出股票成本总额	2,441,732,435.17
买卖股票差价收入	-374,898,613.29

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	51,126,633.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	51,126,633.04

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	726,116,366.79
——股票投资	726,116,366.79
——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	726,116,366.79

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,856,460.13
合计	2,856,460.13

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,412,890.10
银行间市场交易费用	-
合计	7,412,890.10

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	7,844.18
账户服务费	13,500.00
上市费	29,835.26
其他费用	400.00
合计	250,483.60

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2012 年 3 月 23 日, 本基金管理人发布公告, 经本基金管理人股东会审议通过, 并经中国证券监督管理委员会批准, 西南证券股份有限公司受让山西海鑫实业股份有限公司持有的本基金管理人 20% 的股权。本股权转让完成后, 西南证券股份有限公司对本基金管理人的出资比例由 29% 变更为 49%, 山西海鑫实业股份有限公司对本基金管理人的出资比例相应地由 21% 变更为 1%。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
第一创业证券股份有限公司 (“第一创业”)	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司 (“中国民生银行”)	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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	38,915,239.12	26,255,333.24
其中: 支付销售机构的客户维护费	448,319.10	1,098,337.59

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,783,047.84	5,251,066.63

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未持有银华 100、银华稳进、银华锐进份额。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
第一创业	4,480,000.00	0.09%	4,480,000.00	0.12%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方中第一创业于本期末持有本基金份额，其持有的份额为银华稳进份额。对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额总额。除第一创业之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有银华 100、银华稳进、银华锐进基金份额。除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 6.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	654,469,257.68	1,930,898.55	441,088,212.83	1,185,440.78

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.7 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均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，本基金（包括银华 100 份额、银华稳进份额、银华锐进份额）不进行收益分配。

#### 6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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
000059	辽通化工	2012 年 6 月 26 日	刊登重大事项公告	7.91	2012 年 7 月 3 日	8.15	4,611,919	45,543,046.48	36,480,279.29	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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 6.4.12 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约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，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。本基金持有的

大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款及结算备付金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	654,469,257.68	-	-	-	-	-	654,469,257.68
结算备付金	3,702,136.29	-	-	-	-	-	3,702,136.29
存出保证金	-	-	-	-	-	1,750,000.00	1,750,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,646,642,030.76	8,646,642,030.76
应收利息	-	-	-	-	-	149,926.53	149,926.53
应收申购款	40,039,517.69	-	-	-	-	23,627,002.37	63,666,520.06
资产总计	698,210,911.66	-	-	-	-	8,672,168,959.66	9,370,379,871.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	135,635,790.31	135,635,790.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,494,443.76	7,494,443.76
应付托管费	-	-	-	-	-	1,498,888.76	1,498,888.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,660,196.16	2,660,196.16
其他负债	-	-	-	-	-	2,389,925.51	2,389,925.51
负债总计	-	-	-	-	-	149,679,244.50	149,679,244.50
利率敏感度缺口	698,210,911.66	-	-	-	-	8,522,489,715.16	9,220,700,626.82
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	444,946,515.39	-	-	-	-	-	444,946,515.39
结算备付金	3,554,782.40	-	-	-	-	-	3,554,782.40
存出保证金	-	-	-	-	-	1,055,405.02	1,055,405.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,076,374,061.06	7,076,374,061.06
应收利息	-	-	-	-	-	118,706.39	118,706.39
应收申购款	11,280.89	-	-	-	-	163,888.07	175,168.96
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	448,512,578.68	-	-	-	-	7,077,712,060.54	7,526,224,639.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,441,241.20	17,441,241.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,188,279.59	6,188,279.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,237,655.92	1,237,655.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,120,466.06	2,120,466.06
其他负债	-	-	-	-	-	1,415,434.38	1,415,434.38
负债总计	-	-	-	-	-	28,403,077.15	28,403,077.15



利率敏感度缺口	448,512,578.68	-	-	-	-7,049,308,983.39	7,497,821,562.07
---------	----------------	---	---	---	-------------------	------------------

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于 2012 年 6 月 30 日及 2011 年末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此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。

#### 6.4.13.4.2 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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证 100 指数的成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，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%）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。于 2012 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	8,646,642,030.76	93.77	7,076,374,061.06	94.38
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	8,646,642,030.76	93.77	7,076,374,061.06	94.38
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 6.4.13.4.2.2 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（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	+5%	299,858,134.52	370,328,709.01
	-5%	-299,858,134.52	-370,328,709.01

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	8,646,642,030.76	92.28
	其中：股票	8,646,642,030.76	92.28
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	658,171,393.97	7.02
6	其他各项资产	65,566,446.59	0.70
7	合计	9,370,379,871.32	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	38,774,578.20	0.42
B	采掘业	587,060,347.19	6.37
C	制造业	5,024,288,202.32	54.49
C0	食品、饮料	1,176,235,943.72	12.76
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	299,787,757.56	3.25
C5	电子	305,552,780.05	3.31
C6	金属、非金属	1,038,337,007.89	11.26
C7	机械、设备、仪表	1,717,183,190.05	18.62
C8	医药、生物制品	487,191,523.05	5.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	70,316,663.06	0.76
E	建筑业	68,608,126.00	0.74
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	210,641,865.14	2.28
H	批发和零售贸易	314,727,720.46	3.41
I	金融、保险业	814,543,664.81	8.83
J	房地产业	948,991,688.22	10.29
K	社会服务业	151,391,536.78	1.64
L	传播与文化产业	100,077,656.35	1.09
M	综合类	196,151,369.16	2.13
	合计	8,525,573,417.69	92.46

### 7.2.2 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	12,960,215.73	0.14
B	采掘业	-	-
C	制造业	69,196,249.34	0.75
C0	食品、饮料	17,039,137.32	0.18
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,909,938.76	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	42,247,173.26	0.46
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	11,676,353.60	0.13
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	27,235,794.40	0.30
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	121,068,613.07	1.31

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	000002	万科A	62,256,510	554,705,504.10	6.02
2	000858	五粮液	12,872,047	421,688,259.72	4.57
3	000651	格力电器	15,898,366	331,480,931.10	3.59
4	000157	中联重科	29,496,597	295,850,867.91	3.21
5	000001	深发展A	18,879,762	286,217,191.92	3.10
6	002024	苏宁电器	30,971,174	259,848,149.86	2.82
7	002304	洋河股份	1,704,056	229,280,734.80	2.49
8	000568	泸州老窖	5,005,202	211,770,096.62	2.30
9	000063	中兴通讯	13,434,852	187,550,533.92	2.03
10	000776	广发证券	6,010,891	179,304,878.53	1.94
11	000983	西山煤电	11,104,382	173,228,359.20	1.88
12	000338	潍柴动力	5,345,633	158,711,843.77	1.72
13	000527	美的电器	14,118,377	156,008,065.85	1.69
14	000423	东阿阿胶	3,880,749	155,268,767.49	1.68

15	000069	华侨城 A	23,729,081	151,391,536.78	1.64
16	000792	盐湖股份	4,474,191	151,093,430.07	1.64
17	000895	双汇发展	2,275,575	140,812,581.00	1.53
18	000783	长江证券	14,267,748	129,836,506.80	1.41
19	000024	招商地产	5,040,209	123,636,326.77	1.34
20	000629	攀钢钒钛	18,330,703	120,616,025.74	1.31
21	000538	云南白药	1,972,431	116,925,709.68	1.27
22	000425	徐工机械	7,992,958	114,619,017.72	1.24
23	000970	中科三环	2,884,592	114,460,610.56	1.24
24	000402	金融街	17,235,824	112,549,930.72	1.22
25	000100	TCL 集团	55,107,878	111,868,992.34	1.21
26	000630	铜陵有色	5,303,580	102,359,094.00	1.11
27	000623	吉林敖东	5,267,156	91,332,485.04	0.99
28	002142	宁波银行	8,746,454	87,289,610.92	0.95
29	000060	中金岭南	9,683,907	83,475,278.34	0.91
30	000039	中集集团	6,160,404	81,933,373.20	0.89
31	000937	冀中能源	5,167,042	78,900,731.34	0.86
32	000878	云南铜业	4,390,908	78,597,253.20	0.85
33	000709	河北钢铁	28,381,973	77,482,786.29	0.84
34	000012	南玻 A	8,373,086	75,357,774.00	0.82
35	002155	辰州矿业	3,874,696	75,014,114.56	0.81
36	000581	威孚高科	2,728,589	74,763,338.60	0.81
37	000009	中国宝安	6,866,176	68,661,760.00	0.74
38	002081	金螳螂	1,805,477	68,608,126.00	0.74
39	000960	锡业股份	3,476,525	68,487,542.50	0.74
40	000728	国元证券	6,257,668	68,271,157.88	0.74
41	002202	金风科技	10,606,380	67,986,895.80	0.74
42	000758	中色股份	3,494,091	66,282,906.27	0.72
43	000528	柳工	5,228,740	64,888,663.40	0.70
44	000800	一汽轿车	5,968,347	64,816,248.42	0.70
45	000768	西飞国际	8,204,986	64,409,140.10	0.70
46	000562	宏源证券	3,846,694	63,624,318.76	0.69
47	000933	神火股份	6,797,929	61,997,112.48	0.67
48	000422	湖北宜化	5,016,895	61,456,963.75	0.67
49	000917	电广传媒	2,460,583	60,850,217.59	0.66
50	000625	长安汽车	11,900,391	58,073,908.08	0.63
51	000729	燕京啤酒	7,861,110	57,386,103.00	0.62
52	000401	冀东水泥	4,064,697	57,149,639.82	0.62
53	002106	莱宝高科	2,834,413	56,886,668.91	0.62

54	000869	张裕A	834,263	56,112,529.38	0.61
55	000825	太钢不锈	15,732,254	55,534,856.62	0.60
56	002007	华兰生物	2,193,570	53,917,950.60	0.58
57	002092	中泰化学	6,634,913	50,757,084.45	0.55
58	002001	新和成	2,394,324	50,592,066.12	0.55
59	000778	新兴铸管	7,405,655	49,543,831.95	0.54
60	000969	安泰科技	3,935,929	48,136,411.67	0.52
61	000839	中信国安	7,114,809	47,811,516.48	0.52
62	000876	新希望	3,179,595	47,630,333.10	0.52
63	000718	苏宁环球	5,630,520	45,607,212.00	0.49
64	000061	农产品	7,714,382	44,743,415.60	0.49
65	002146	荣盛发展	4,085,844	44,535,699.60	0.48
66	000680	山推股份	6,932,504	40,555,148.40	0.44
67	000762	西藏矿业	2,754,417	39,443,251.44	0.43
68	000877	天山股份	4,032,732	39,319,137.00	0.43
69	000793	华闻传媒	6,347,482	39,227,438.76	0.43
70	000898	鞍钢股份	10,011,008	39,042,931.20	0.42
71	002069	獐子岛	1,859,692	38,774,578.20	0.42
72	000540	中天城投	5,150,200	38,008,476.00	0.41
73	002073	软控股份	4,367,539	36,599,976.82	0.40
74	000046	泛海建设	8,183,187	36,578,845.89	0.40
75	000059	辽通化工	4,611,919	36,480,279.29	0.40
76	000027	深圳能源	5,538,778	35,835,893.66	0.39
77	002008	大族激光	5,593,323	35,126,068.44	0.38
78	000539	粤电力A	5,224,359	34,480,769.40	0.37
79	000780	平庄能源	3,027,631	31,729,572.88	0.34
80	000031	中粮地产	6,911,491	31,378,169.14	0.34
81	002128	露天煤业	2,328,794	30,460,625.52	0.33
82	000968	煤气化	1,967,454	30,003,673.50	0.33
83	000559	万向钱潮	5,950,662	29,931,829.86	0.32
84	000652	泰达股份	7,504,523	29,342,684.93	0.32
85	000612	焦作万方	2,449,214	28,435,374.54	0.31
86	000550	江铃汽车	1,250,822	26,705,049.70	0.29
87	002122	天马股份	4,050,174	26,164,124.04	0.28
88	000021	长城开发	4,292,069	23,091,331.22	0.25
89	002056	横店东磁	1,403,047	22,336,508.24	0.24
90	002006	精工科技	2,077,267	22,102,120.88	0.24
91	002233	塔牌集团	2,362,197	21,826,700.28	0.24
92	000927	一汽夏利	2,952,226	21,639,816.58	0.23

93	000522	白云山 A	941,718	19,154,544.12	0.21
94	000541	佛山照明	1,599,822	13,806,463.86	0.15
95	000400	许继电气	826,016	12,943,670.72	0.14
96	000503	海虹控股	2,121,675	12,326,931.75	0.13
97	000930	中粮生化	2,377,635	11,555,306.10	0.13
98	000786	北新建材	853,091	11,038,997.54	0.12
99	000829	天音控股	1,554,625	10,136,155.00	0.11

### 7.3.2 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	002241	歌尔声学	1,157,774	42,247,173.26	0.46
2	000826	桑德环境	1,189,336	27,235,794.40	0.30
3	000596	古井贡酒	360,693	17,039,137.32	0.18
4	002041	登海种业	623,387	12,960,215.73	0.14
5	002269	美邦服饰	484,496	11,676,353.60	0.13
6	002292	奥飞动漫	473,254	9,909,938.76	0.11

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	000002	万科 A	182,241,832.22	2.43
2	000858	五粮液	142,770,479.20	1.90
3	000651	格力电器	124,014,349.62	1.65
4	000157	中联重科	103,088,889.33	1.37
5	002024	苏宁电器	96,051,543.35	1.28
6	000001	深发展 A	87,918,972.55	1.17
7	002304	洋河股份	77,486,678.44	1.03
8	000063	中兴通讯	71,982,580.22	0.96
9	000568	泸州老窖	68,125,986.55	0.91
10	000527	美的电器	67,430,446.73	0.90
11	000776	广发证券	63,496,729.10	0.85



12	000983	西山煤电	62,417,187.58	0.83
13	000338	潍柴动力	58,827,056.55	0.78
14	000423	东阿阿胶	53,150,786.11	0.71
15	000792	盐湖股份	52,941,208.37	0.71
16	000970	中科三环	50,318,499.88	0.67
17	000895	双汇发展	49,092,131.67	0.65
18	000783	长江证券	48,569,287.33	0.65
19	000069	华侨城 A	48,292,487.37	0.64
20	000425	徐工机械	47,054,527.20	0.63

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。

#### 7.4.2 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	000002	万科 A	106,236,270.21	1.42
2	000858	五粮液	92,466,106.95	1.23
3	002024	苏宁电器	60,815,550.22	0.81
4	000157	中联重科	60,587,324.68	0.81
5	000651	格力电器	59,148,903.62	0.79
6	000001	深发展 A	56,368,362.55	0.75
7	000063	中兴通讯	45,396,946.75	0.61
8	000568	泸州老窖	42,396,742.41	0.57
9	002304	洋河股份	40,356,212.00	0.54
10	000983	西山煤电	39,781,272.16	0.53
11	000527	美的电器	38,682,759.88	0.52
12	000338	潍柴动力	38,632,178.05	0.52
13	000423	东阿阿胶	35,458,998.92	0.47
14	000776	广发证券	35,318,597.72	0.47
15	000895	双汇发展	32,488,141.20	0.43
16	000792	盐湖股份	32,461,907.33	0.43
17	000069	华侨城 A	30,081,950.88	0.40
18	000629	攀钢钒钛	28,960,804.46	0.39
19	000541	佛山照明	28,765,504.08	0.38
20	000522	白云山 A	27,871,438.08	0.37

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。

### 7.4.3 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	3,285,884,038.08
卖出股票收入（成交）总额	2,066,833,821.88

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。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1 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。**

**7.9.2 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。**

### 7.9.3 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	1,750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	149,926.53
5	应收申购款	63,666,520.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	65,566,446.59

### 7.9.4 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。

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.9.5.1 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。

#### 7.9.5.2 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情况。

### 7.9.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
银华稳进	5,255	898,914.29	3,951,502,501.00	83.65%	772,292,079.00	16.35%
银华锐进	44,747	105,566.73	1,875,232,546.00	39.70%	2,848,562,034.00	60.30%
银华 100	29,466	47,775.87	737,578,351.47	52.39%	670,185,316.49	47.61%
合计	79,468	136,600.30	6,564,313,398.47	60.47%	4,291,039,429.49	39.53%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

银华稳进

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	红塔证券股份有限公司	263,119,937.00	5.57%
2	中国人寿再保险股份有限公司	254,315,000.00	5.38%
3	中诚信托有限责任公司—交行固定收益单一信托	220,964,274.00	4.68%
4	中国出口信用保险公司	216,487,615.00	4.58%

5	幸福人寿保险股份有限公司-分红	198,578,763.00	4.20%
6	光大永明人寿保险有限公司	185,910,875.00	3.94%
7	中油财务有限责任公司	180,914,534.00	3.83%
8	华宝信托有限责任公司-单一类资 金信托 R2007ZX106	134,982,020.00	2.86%
9	中荷人寿保险有限公司	127,204,585.00	2.69%
10	渤海证券股份有限公司	110,329,999.00	2.34%

银华锐进

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	太平人寿保险有限公司	221,825,791.00	4.70%
2	光大永明人寿保险有限公司	189,890,870.00	4.02%
3	中国平安人寿保险股份有限公司	137,517,872.00	2.91%
4	太平财产保险有限公司	109,251,832.00	2.31%
5	华创证券有限责任公司	82,200,000.00	1.74%
6	中国财产再保险股份有限公司-传 统-普通保险产品	74,255,000.00	1.57%
7	合众人寿保险股份有限公司-传 统-普通保险产品	56,550,590.00	1.20%
8	中国对外经济贸易信托有限公司- 鸿道 3 期	50,285,000.00	1.06%
9	山东省国际信托有限公司-鸿道 1 期集合资金信托	40,568,400.00	0.86%
10	中国平安人寿保险股份有限公司- 万能-一个险万能	37,774,586.00	0.80%

注：(1)、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；

(2)、对于银华稳进、银华锐进前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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 员持有本基金	银华稳进	-	-
	银华锐进	2,700.00	0.00%
	银华 100	931,534.46	0.07%
	合计	934,234.46	0.01%

注：1、对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

2、截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳进	银华锐进	银华 100
基金合同生效日（2010 年 5 月 7 日）基金份额总额	227,454,845.00	227,454,845.00	1,748,978,674.95
本报告期期初基金份额总额	3,811,634,801.00	3,811,634,801.00	1,399,963,647.12
本报告期基金总申购份额	-	-	4,373,277,973.69
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	2,873,793,593.52
本报告期基金拆分变动份额	912,159,779.00	912,159,779.00	-1,491,684,359.33
本报告期期末基金份额总额	4,723,794,580.00	4,723,794,580.00	1,407,763,667.96

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金定期份额折算中新增加的份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

10.2.1.1 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；

10.2.1.2 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；

10.2.1.3 2012 年 7 月 20 日，本基金管理人发布公告，本基金管理人拟任董事长王珠林先生高管任职资格已经中国证监会核准，王珠林先生自 2012 年 7 月 18 日起担任本基金管理人董事长职务。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2012 年 6 月 9 日，本基金托管人中国民生银行发布公告，经中国民生银行研究决定，聘任刘滔棠为中国民生银行资产托管部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕511 号）。

### 10.3 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、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为其审计的会计事务所。

### 10.6 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中国银河证券股份有限公司	2	1,688,963,790.64	31.59%	1,402,735.70	31.77%	-
申银万国证券股份有限公司	1	1,604,293,971.61	30.01%	1,323,003.36	29.97%	新增一个交易单元
民生证券有限责任公司	1	1,157,724,279.62	21.66%	956,816.44	21.67%	-
国信证券股份有限公司	1	392,947,688.23	7.35%	319,273.30	7.23%	-
英大证券有限责任公司	1	237,194,160.56	4.44%	197,703.36	4.48%	-
浙商证券有限责任公司	2	158,245,800.22	2.96%	128,575.47	2.91%	-
江海证券有限公司	1	106,617,330.68	1.99%	86,626.88	1.96%	新增一个交易单元

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、



个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

### 10.8 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	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
2	《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》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
3	《银华深证 100 指数分级证券投资基金更新招募说明书及摘要（2012 年第 1 号）》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 6 月 21 日
4	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券网上申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 5 月 30 日
5	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 5 月 21 日
6	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加重庆银行网上申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 5 月 21 日
7	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 5 月 12 日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在东吴证券开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 5 月 9 日
9	《银华基金管理有限公司关于增加包商银行为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 26 日
10	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2012 年第 1 季度报告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 24 日
11	《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》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 19 日
12	《银华基金管理有限公司关于开通“易购通”基金网上直销第三方支付业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 18 日
13	《银华基金管理有限公司关于增加大通证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 11 日
14	《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电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
15	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
16	《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》	三大证券报及本	2012 年 3 月 30 日



	公告》	基金管理人网站	
17	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2011 年年度报告及摘要》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 27 日
18	《银华基金管理有限公司关于公司股东出资比例变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 23 日
19	《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》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 29 日
20	《银华基金管理有限公司关于董事变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 23 日
21	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 16 日
22	《银华基金关于调整公司旗下分级基金份额配对转换业务中“合并”及“分拆”每笔申请最低份额数限制的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 15 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 4 日
24	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2011 年第 4 季度报告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 20 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 19 日
26	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 18 日
27	《关于银华深证 100 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 6 日
28	《银华深证 100 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间银华稳进份额停牌的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 5 日
29	《银华深证 100 指数分级证券投资基金之银华稳进份额 2012 年度约定年基准收益率的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 5 日
30	《银华基金管理有限公司 2011 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 4 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准银华深证 100 指数分级证券投资基金设立的文件

12.1.2 《银华深证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》

- 12.1.3 《银华深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

## 12.2 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。

## 12.3 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理有限公司  
2012 年 8 月 24 日