银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金
2015年半年度报告摘要

2015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：中国银行股份有限公司

送出日期：2015年8月26日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金		
基金简称	银华中证 800 等权指数增强分级		
场内简称	800 分级		
基金主代码	161825		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 11 月 5 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	148,341,582.72 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	2013-12-11		
下属分级基金的基金简称	中证 800A	中证 800B	800 分级
下属分级基金的交易代码	150138	150139	161825
报告期末下属分级基金份额总额	40,546,701.00 份	40,546,701.00 份	67,248,180.72 份

注：本基金管理人于 2015 年 4 月 30 日发布公告，自 2015 年 5 月 4 日起将本基金的基础份额的场内简称由“银华 800”变更为“800 分级”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证 800 等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以中证 800 等权重指数为目标指数，在有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。 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中证 800 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%－95%，其中投资于股票的

	资产不低于基金资产的85%，投资于中证800等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。		
业绩比较基准	95%×中证800等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，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水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。		
下属分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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95566
传真		(010)58163027	（010）66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	38,084,243.15
本期利润	31,470,922.08
加权平均基金份额本期利润	0.3572
本期加权平均净值利润率	31.24%
本期基金份额净值增长率	48.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	65,613,981.77
期末可供分配基金份额利润	0.4423

期末基金资产净值	127,490,213.49
期末基金份额净值	0.859
3.1.3 累计期末指标	报告期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）
基金份额累计净值增长率	105.93%

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。

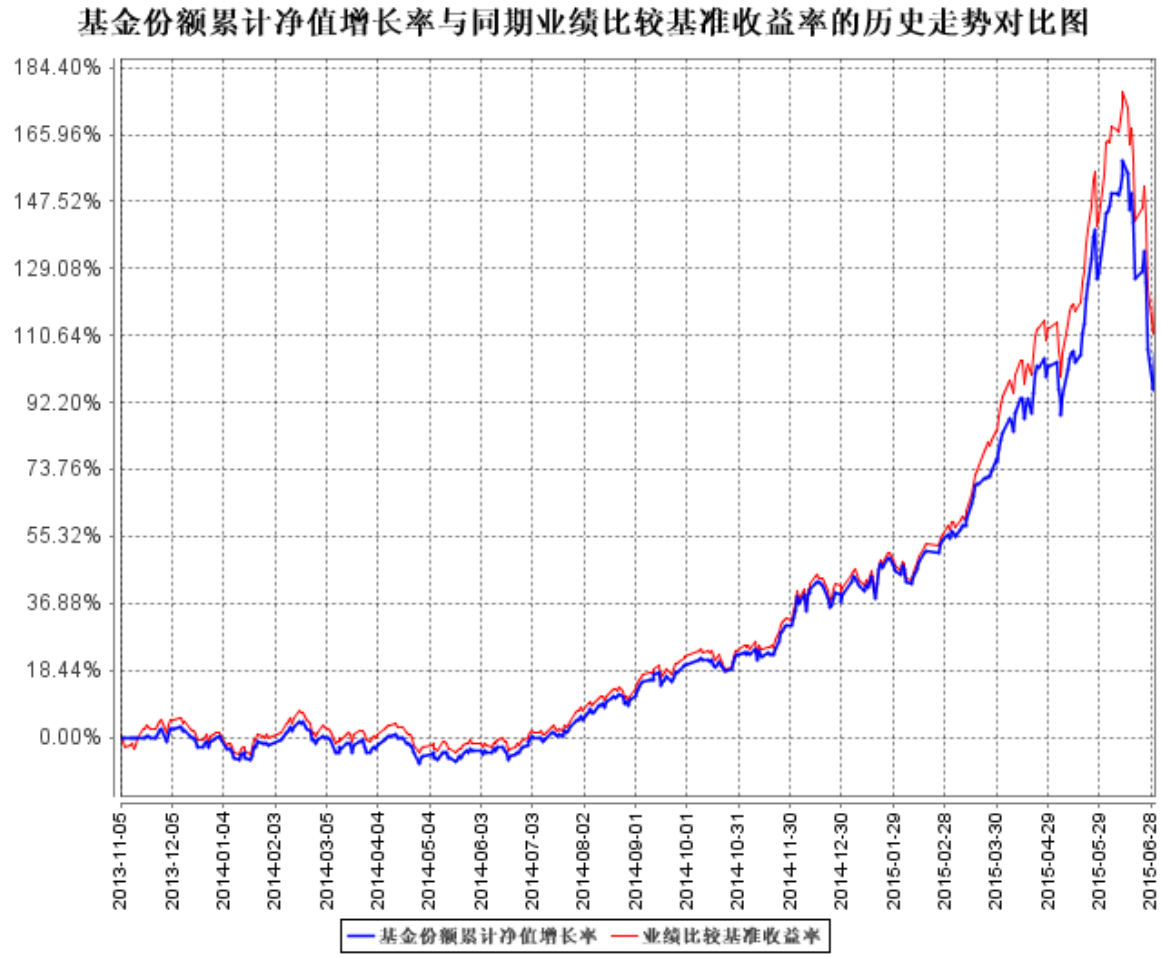
3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.67%	3.53%	-8.30%	3.56%	-1.37%	-0.03%
过去三个月	17.14%	2.67%	20.62%	2.69%	-3.48%	-0.02%
过去六个月	48.02%	2.10%	57.37%	2.14%	-9.35%	-0.04%
过去一年	109.94%	1.64%	122.24%	1.69%	-12.30%	-0.05%
自基金合同生效起至今	105.93%	1.44%	122.42%	1.50%	-16.49%	-0.06%

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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%-95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成分股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

§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 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 50 只证券投资基金，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 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金（LOF）、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、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金（LOF）、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金。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、公司副总经理、境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监	2013 年 11 月 5 日	-	16 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，2010 年 12 月 6 日至 2012 年 11 月 7 日期间兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。自 2010 年 5 月 7 日起兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，具有从业资格。国籍：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013 年 11 月 5 日	-	5.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起兼任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理。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遵规守信情况的说明

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、《银华中证 800 等权重指数增强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 1 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，我们运用自行开发的投资管理系统，结合量化投资技术和基本面分析对投资组合进行积极的管理和风险控制。本报告期的中前期，本基金小幅度跑赢基准，该结果在模型的收益风险特征预期之内，然而在报告末期市场大幅波动时，大规模的申购赎回导致股票仓位变化剧烈，与基准指数走势发生一定偏差。

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 0.859 元，本报告期份额净值增长率为 48.02%，同期业绩比较基准收益率为 57.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年是 A 股历史上最不平凡的半年，在经历了五个多月的单边巨幅上涨后，在半个月的时间内又经历了近乎雪崩式的巨幅下跌。以创业板为代表的高成长性板块，大幅度跑赢以沪深 300 为代表的传统蓝筹板块，创业板指数半年内最高涨幅一度高达 170%，部分热门主题个股涨幅更是惊人；而 6 月的后半个月，以创业板为代表的部分高成长股票开始连续跌停，投资者陷入恐慌，整个权益市场的流动性一度接近枯竭。然而管理层的坚决出手迅速稳定住了局面，并有效地防范了流动性危机转化为金融危机。

我们认为，尽管 A 股经历了一番惊心动魄的恐慌抛售，但驱动长线牛市的基本面、政策面和资金面的因素还在，本轮牛市“改革+创新”的逻辑也还在。一番泥沙俱下的大幅调整，为投资者买到低价优质的资产提供了充分的机会和足够的安全边际。

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历。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，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2014 年 12 月 18 日至 2015 年 2 月 27 日。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

§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：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金
报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	10,751,681.88	4,053,510.20
结算备付金		346,804.68	329,962.07
存出保证金		24,123.03	60,817.16
交易性金融资产	6.4.7.2	121,062,796.57	40,149,537.94
其中：股票投资		121,062,796.57	40,149,537.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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	3,007.38	1,224.08
应收股利		-	-
应收申购款		345,159.95	1,239,294.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		132,533,573.49	45,834,345.46
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	0.58
应付赎回款		4,176,336.61	1,260,813.71
应付管理人报酬		137,361.00	35,638.12
应付托管费		27,472.20	7,127.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	383,319.82	206,147.62
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	318,870.37	204,733.09
负债合计		5,043,360.00	1,714,460.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	61,876,231.72	31,705,146.55
未分配利润	6.4.7.10	65,613,981.77	12,414,738.18
所有者权益合计		127,490,213.49	44,119,884.73
负债和所有者权益总计		132,533,573.49	45,834,345.46

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，800 分级份额净值为人民币 0.859 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.006 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.712 元；基金份额总额为 148,341,582.72 份，其中 800 分级份额为 67,248,180.72 份，中证 800A 份额为 40,546,701.00 份，中证 800B 份额为 40,546,701.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		33,674,720.20	3,101,944.45
1.利息收入		64,075.77	34,964.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,075.77	34,964.56
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）		39,719,345.70	-199,102.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	39,252,092.66	-778,861.63
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		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	467,253.04	579,759.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,613,321.07	3,112,906.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	504,619.80	153,175.42
减：二、费用		2,203,798.12	2,607,688.99
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	486,814.55	502,052.39
2．托管费	6.4.10.2.2	97,362.89	100,410.48
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	1,300,013.90	1,691,592.47
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	319,606.78	313,633.65
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		31,470,922.08	494,255.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,470,922.08	494,255.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	31,705,146.55	12,414,738.18	44,119,884.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,470,922.08	31,470,922.08
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）	30,171,085.17	21,728,321.51	51,899,406.68
其中：1.基金申购款	244,669,695.09	214,783,860.82	459,453,555.91
2.基金赎回款	-214,498,609.92	-193,055,539.31	-407,554,149.23
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）	61,876,231.72	65,613,981.77	127,490,213.49
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	189,036,621.22	-484,581.79	188,552,039.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	494,255.46	494,255.46
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）	-117,539,272.86	-1,359,060.13	-118,898,332.99
其中：1.基金申购款	3,779,939.34	-139,306.11	3,640,633.23
2.基金赎回款	-121,319,212.20	-1,219,754.02	-122,538,966.22
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）	71,497,348.36	-1,349,386.46	70,147,961.90

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	杨清	龚飒
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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的说明

除6.4.2.2会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外，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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自2015年3月25日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.2.3 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。

6.4.3 税项

7.4.6.1 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[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》，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。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，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[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》，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》，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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》，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，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.4.2 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
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.5.1 关联方报酬

6.4.5.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	486,814.55	502,052.39
其中：支付销售机构的客户维护费	61,003.20	181,757.91

注：基金管理费每日计提，按月支付。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×1.00%/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

6.4.5.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	97,362.89	100,410.48

注：基金托管费每日计提，按月支付。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×0.20%/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

6.4.5.2 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通过关联方交易单元进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.5.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人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份额。

6.4.5.3.2 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：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

6.4.5.4 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国银行	10,751,681.88	58,727.64	3,587,722.74	22,875.76

6.4.5.5 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在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.6 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需要说明的其他关联交易事项。

6.4.6 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 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/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.6.2 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
601789	宁波建工	2015 年 6 月 15 日	重大事项	18.80	2015 年 8 月 13 日	16.81	24,084	315,514.73	452,779.20	-
000688	建新矿业	2015 年	重大事项	17.07	-	-	26,346	274,890.62	449,726.22	-

		6月10日								
002194	武汉凡谷	2015年6月18日	重大事项	26.98	2015年7月24日	24.28	13,891	310,643.26	374,779.18	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大事项	22.44	-	-	14,889	250,641.83	334,109.16	-
000566	海南海药	2015年6月18日	重大事项	49.97	-	-	6,620	277,798.52	330,801.40	-
600641	万业企业	2015年6月12日	重大事项	11.23	-	-	29,359	243,859.83	329,701.57	-
002308	威创股份	2015年6月12日	重大事项	31.00	-	-	10,113	205,110.43	313,503.00	-
002445	中南重工	2015年6月2日	重大事项	57.80	-	-	5,410	226,192.10	312,698.00	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大事项	21.54	-	-	14,128	273,991.25	304,317.12	-
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	6,863	202,842.04	302,521.04	-
300360	炬华科技	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	6,800	269,144.00	299,744.00	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	-	-	15,692	253,995.42	290,772.76	-
002309	中利科技	2015年	重大事项	33.39	2015年	30.05	8,031	211,212.76	268,155.09	-

		6月2日			7月21日					
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项	76.47	2015年7月20日	68.82	3,429	246,113.20	262,215.63	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	重大事项	19.22	-	-	13,511	204,599.44	259,681.42	-
601718	际华集团	2015年6月17日	重大事项	15.12	2015年7月2日	13.61	16,451	163,899.68	248,739.12	-
000650	仁和药业	2015年6月12日	重大事项	17.17	-	-	14,158	178,036.01	243,092.86	-
000850	华茂股份	2015年5月7日	重大事项	10.98	-	-	21,433	232,815.10	235,334.34	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大事项	12.96	-	-	18,023	142,289.47	233,578.08	-
002183	怡亚通	2015年6月1日	重大事项	73.15	-	-	3,167	133,438.38	231,666.05	-
300158	振东制药	2015年4月27日	重大事项	18.90	-	-	11,859	192,329.39	224,135.10	-
600110	中科英华	2015年6月26日	重大事项	13.73	-	-	16,194	169,127.94	222,343.62	-
002223	鱼跃医疗	2015年6月25日	重大事项	67.20	2015年7月13日	60.48	3,255	153,576.15	218,736.00	-
000748	长城信息	2015年	重大事项	34.88	-	-	6,236	203,222.34	217,511.68	-

		6月18日								
002226	江南化工	2015年6月8日	重大事项	13.18	-	-	16,212	172,430.82	213,674.16	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项	37.76	2015年7月13日	34.65	5,500	278,731.00	207,680.00	-
000683	远兴能源	2015年6月15日	重大事项	11.52	2015年8月18日	10.37	17,815	126,959.99	205,228.80	-
000539	粤电力A	2015年6月8日	重大事项	11.94	2015年7月21日	10.75	17,011	111,439.56	203,111.34	-
002375	亚厦股份	2015年6月17日	重大事项	29.21	2015年7月20日	26.29	6,684	166,468.21	195,239.64	-
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	71.48	2015年8月5日	69.20	2,715	185,306.11	194,068.20	-
000709	河北钢铁	2015年6月30日	重大事项	7.00	2015年8月24日	6.30	27,375	141,544.52	191,625.00	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项	34.20	2015年7月2日	30.78	5,584	189,340.21	190,972.80	-
000543	皖能电力	2015年6月15日	重大事项	21.36	2015年7月14日	19.22	8,678	144,671.92	185,362.08	-
600335	国机汽车	2015年6月15日	重大事项	37.93	2015年7月21日	34.14	4,711	144,291.87	178,688.23	-
601021	春秋航空	2015年	重大事项	126.09	2015年	113.48	1,400	184,474.00	176,526.00	-

		6月26日			7月21日					
000839	中信国安	2015年6月29日	重大事项	23.57	-	-	7,429	161,905.80	175,101.53	-
601111	中国国航	2015年6月30日	重大事项	15.36	2015年7月29日	13.78	11,149	123,882.57	171,248.64	-
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	17.51	-	-	9,755	150,764.17	170,810.05	-
600886	国投电力	2015年6月24日	重大事项	14.87	-	-	11,337	131,459.23	168,581.19	-
000592	平潭发展	2015年6月30日	重大事项	29.76	2015年7月14日	30.00	5,600	219,904.00	166,656.00	-
600175	美都能源	2015年6月29日	重大事项	10.64	2015年7月20日	9.58	15,455	139,744.60	164,441.20	-
002242	九阳股份	2015年6月15日	重大事项	19.45	2015年7月7日	17.51	8,082	133,289.09	157,194.90	-
600869	智慧能源	2015年5月11日	重大事项	32.06	2015年7月31日	26.23	4,895	90,714.96	156,933.70	-
600654	中安消	2015年6月29日	重大事项	30.91	-	-	4,985	161,567.97	154,086.35	-
601311	骆驼股份	2015年6月18日	重大事项	23.31	2015年7月15日	25.38	6,525	159,830.25	152,097.75	-
600702	沱牌舍得	2015年	重大事项	26.11	2015年	28.00	5,669	135,906.26	148,017.59	-

		6月29日			8月20日					
000519	江南红箭	2015年6月15日	重大事项	26.06	-	-	5,664	118,967.30	147,603.84	-
601633	长城汽车	2015年6月19日	重大事项	42.76	2015年7月13日	38.50	3,420	165,943.54	146,239.20	-
600900	长江电力	2015年6月15日	重大事项	14.35	-	-	10,077	132,034.75	144,604.95	-
002557	洽洽食品	2015年6月29日	重大事项	16.38	2015年8月24日	14.74	8,807	171,431.40	144,258.66	-
601216	内蒙君正	2015年6月29日	重大事项	24.07	2015年7月2日	24.20	5,889	163,567.68	141,748.23	-
600520	中发科技	2015年5月26日	重大事项	36.09	2015年7月24日	32.48	3,891	101,153.03	140,426.19	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	重大事项	16.73	-	-	8,385	157,254.02	140,281.05	-
002143	印纪传媒	2015年6月30日	重大事项	32.01	2015年7月1日	33.50	4,347	141,921.14	139,147.47	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	重大事项	23.76	-	-	5,853	139,776.64	139,067.28	-
000887	中鼎股份	2015年6月30日	重大事项	24.75	-	-	5,600	171,799.95	138,600.00	-
002276	万马股份	2015年	重大事项	34.15	2015年	30.74	4,030	134,230.11	137,624.50	-

		6月30日			7月20日					
600312	平高电气	2015年6月23日	重大事项	22.58	-	-	6,026	140,760.03	136,067.08	-
001696	宗申动力	2015年6月30日	重大事项	17.25	2015年8月24日	15.53	7,851	179,949.60	135,429.75	-
601877	正泰电器	2015年5月18日	重大事项	31.38	-	-	4,245	128,314.50	133,208.10	-
002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项	31.15	-	-	4,262	96,405.57	132,761.30	-
000672	上峰水泥	2015年6月3日	重大事项	12.05	-	-	10,989	109,074.88	132,417.45	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	重大事项	29.64	-	-	4,440	113,346.03	131,601.60	-
002001	新和成	2015年6月30日	重大事项	17.09	2015年7月13日	18.49	7,282	138,169.50	124,449.38	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项	27.70	2015年7月1日	30.00	4,344	146,431.56	120,328.80	-
000693	华泽钴镍	2015年6月30日	重大事项	20.57	2015年8月18日	22.63	5,820	165,444.75	119,717.40	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项	15.71	2015年8月19日	14.00	7,308	98,373.69	114,808.68	-
002727	一心堂	2015年	重大事项	78.24	2015年	70.42	1,357	76,336.40	106,171.68	-

		4月13日			8月17日					
600482	风帆股份	2015年5月28日	重大事项	42.38	-	-	2,494	55,431.70	105,695.72	-
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项	18.58	-	-	5,684	89,288.42	105,608.72	-
002269	美邦服饰	2015年5月22日	重大事项	11.86	2015年7月2日	10.67	8,672	57,580.45	102,849.92	-
002345	潮宏基	2015年5月22日	重大事项	19.58	-	-	5,050	63,399.61	98,879.00	-
600078	澄星股份	2015年6月9日	重大事项	15.23	2015年7月1日	13.71	6,416	75,375.99	97,715.68	-
600872	中炬高新	2015年5月4日	重大事项	23.17	-	-	4,081	56,561.48	94,556.77	-
000979	中弘股份	2015年5月25日	重大事项	6.04	-	-	15,016	63,673.71	90,696.64	-
600967	北方创业	2015年4月13日	重大事项	20.86	-	-	4,289	68,261.76	89,468.54	-
600645	中源协和	2015年4月27日	重大事项	81.32	-	-	1,074	63,390.47	87,337.68	-
002574	明牌珠宝	2015年6月4日	重大事项	22.90	-	-	3,708	53,840.05	84,913.20	-
600790	轻纺城	2015年	重大事项	13.38	2015年	12.04	6,153	56,334.60	82,327.14	-

		5月25日			8月18日					
002310	东方园林	2015年5月27日	重大事项	38.30	-	-	2,149	49,637.91	82,306.70	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大事项	37.29	-	-	2,204	48,360.90	82,187.16	-
000669	金鸿能源	2015年5月4日	重大事项	41.70	2015年7月23日	33.95	1,963	63,025.18	81,857.10	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项	65.52	-	-	1,232	54,746.24	80,720.64	-
600587	新华医疗	2015年5月22日	重大事项	58.63	2015年7月3日	52.77	1,359	58,555.46	79,678.17	-
000959	首钢股份	2015年4月23日	重大事项	6.15	-	-	12,871	63,152.07	79,156.65	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项	36.50	-	-	2,149	58,155.15	78,438.50	-
002416	爱施德	2015年5月5日	重大事项	20.67	2015年7月29日	18.60	3,765	67,503.67	77,822.55	-
002414	高德红外	2015年5月13日	重大事项	39.32	-	-	1,915	50,746.77	75,297.80	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	重大事项	47.84	2015年7月22日	43.06	1,558	47,863.12	74,534.72	-
000697	炼石有色	2015年	重大事项	33.83	-	-	2,150	59,301.64	72,734.50	-

		5月18日								
600366	宁波韵升	2015年5月22日	重大事项	30.71	2015年8月12日	31.58	2,368	54,942.09	72,721.28	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项	30.81	-	-	2,294	55,749.83	70,678.14	-
600277	亿利能源	2015年6月1日	重大事项	14.62	-	-	4,722	51,994.83	69,035.64	-
002091	江苏国泰	2015年6月1日	重大事项	26.22	-	-	2,560	49,316.35	67,123.20	-
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大事项	22.64	2015年7月20日	20.35	2,933	51,448.17	66,403.12	-
002461	珠江啤酒	2015年6月4日	重大事项	26.40	2015年7月24日	23.76	2,494	40,312.68	65,841.60	-
600258	首旅酒店	2015年3月17日	重大事项	18.55	-	-	3,482	58,876.48	64,591.10	-
002662	京威股份	2015年5月15日	重大事项	17.84	2015年8月13日	16.06	3,613	60,616.84	64,455.92	-
002203	海亮股份	2015年4月27日	重大事项	12.71	-	-	4,876	49,753.35	61,973.96	-
002106	莱宝高科	2015年4月7日	重大事项	16.42	-	-	3,774	57,748.83	61,969.08	-
002069	獐子岛	2015年	重大事项	19.76	-	-	3,105	48,222.61	61,354.80	-

		6月1日								
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	16.89	-	-	3,526	57,185.81	59,554.14	-
000788	北大医药	2015年5月25日	重大事项	20.72	2015年7月21日	18.65	2,785	50,404.49	57,705.20	-
600333	长春燃气	2015年5月29日	重大事项	11.97	2015年7月9日	10.77	4,796	45,929.17	57,408.12	-
600879	航天电子	2015年5月15日	重大事项	23.59	-	-	2,363	45,656.52	55,743.17	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	35.04	-	-	1,256	47,592.11	44,010.24	-
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大事项	10.32	-	-	2,944	22,090.25	30,382.08	-
000761	本钢板材	2015年6月23日	重大事项	7.75	2015年7月21日	6.93	3,559	22,704.63	27,582.25	-
000982	中银绒业	2014年8月25日	重大事项	4.64	-	-	840	3,768.30	3,897.60	-
600575	皖江物流	2014年9月8日	重大事项	4.11	-	-	308	1,173.27	1,265.88	-

6.4.6.3 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。

6.4.7 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。

§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	121,062,796.57	91.35
	其中：股票	121,062,796.57	91.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,098,486.56	8.37
7	其他各项资产	372,290.36	0.28
8	合计	132,533,573.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,260,668.25	0.99
B	采矿业	6,668,263.27	5.23
C	制造业	63,489,030.31	49.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,086,610.16	3.99
E	建筑业	3,547,938.73	2.78
F	批发和零售业	6,419,349.52	5.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,474,070.12	3.51
H	住宿和餐饮业	147,808.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,666,663.96	4.44
J	金融业	6,549,948.14	5.14
K	房地产业	6,214,678.17	4.87

L	租赁和商务服务业	2,285,487.96	1.79
M	科学研究和技术服务业	352,357.55	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	901,768.07	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	290,313.36	0.23
R	文化、体育和娱乐业	3,178,634.14	2.49
S	综合	1,033,940.76	0.81
	合计	117,567,530.47	92.22

7.2.2 期末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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,194,824.00	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	452,779.20	0.36
F	批发和零售业	453,370.23	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	329,701.57	0.26
L	租赁和商务服务业	64,591.10	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,495,266.10	2.74

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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前十名股票投资明细

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	000688	建新矿业	26,346	449,726.22	0.35
2	002194	武汉凡谷	13,891	374,779.18	0.29
3	600978	宜华木业	14,889	334,109.16	0.26
4	000566	海南海药	6,620	330,801.40	0.26
5	002308	威创股份	10,113	313,503.00	0.25
6	000066	长城电脑	14,128	304,317.12	0.24
7	000001	平安银行	20,922	304,205.88	0.24
8	002018	华信国际	6,863	302,521.04	0.24
9	000878	云南铜业	15,692	290,772.76	0.23
10	600030	中信证券	10,181	273,970.71	0.21

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票信息，应阅读登载于

http://www.yhfund.com.cn 网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	601789	宁波建工	24,084	452,779.20	0.36
2	600828	成商集团	35,972	375,547.68	0.29
3	600641	万业企业	29,359	329,701.57	0.26
4	002445	中南重工	5,410	312,698.00	0.25
5	300360	炬华科技	6,800	299,744.00	0.24

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票信息，应阅读登载于

http://www.yhfund.com.cn 网站的半年度报告正文。

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	000001	平安银行	2,863,748.88	6.49
2	000776	广发证券	2,455,661.83	5.57
3	601166	兴业银行	2,445,861.00	5.54
4	601328	交通银行	2,286,802.00	5.18
5	601318	中国平安	2,110,262.00	4.78
6	600551	时代出版	2,031,511.94	4.60
7	601939	建设银行	1,856,983.00	4.21
8	601998	中信银行	1,705,105.00	3.86
9	601098	中南传媒	1,572,952.86	3.57
10	601186	中国铁建	1,517,828.00	3.44
11	002142	宁波银行	1,462,302.00	3.31
12	601088	中国神华	1,462,299.00	3.31
13	601168	西部矿业	1,448,911.79	3.28
14	601009	南京银行	1,444,294.66	3.27
15	601886	江河创建	1,425,164.00	3.23
16	600362	江西铜业	1,420,455.33	3.22
17	600000	浦发银行	1,405,014.00	3.18
18	600546	山煤国际	1,393,941.00	3.16
19	002445	中南重工	1,389,672.76	3.15
20	601169	北京银行	1,389,431.00	3.15
21	601398	工商银行	1,388,118.00	3.15
22	600036	招商银行	1,374,083.00	3.11
23	000623	吉林敖东	1,358,514.00	3.08
24	000688	建新矿业	1,349,624.19	3.06
25	600757	长江传媒	1,346,991.16	3.05
26	600016	民生银行	1,327,611.00	3.01
27	601288	农业银行	1,320,788.00	2.99
28	000869	张　裕A	1,319,080.00	2.99
29	600015	华夏银行	1,310,555.00	2.97
30	000858	五 粮 液	1,310,511.00	2.97
31	601929	吉视传媒	1,275,883.00	2.89
32	000751	锌业股份	1,273,901.00	2.89
33	600199	金种子酒	1,272,804.92	2.88
34	600216	浙江医药	1,271,503.00	2.88

35	000848	承德露露	1,269,832.00	2.88
36	601818	光大银行	1,262,113.00	2.86
37	601607	上海医药	1,261,494.14	2.86
38	600252	中恒集团	1,248,133.50	2.83
39	600812	华北制药	1,242,828.00	2.82
40	600488	天药股份	1,234,669.00	2.80
41	600997	开滦股份	1,209,594.00	2.74
42	600037	歌华有线	1,193,651.00	2.71
43	600067	冠城大通	1,192,491.00	2.70
44	000963	华东医药	1,185,158.00	2.69
45	601668	中国建筑	1,178,801.00	2.67
46	000402	金 融 街	1,178,048.00	2.67
47	600859	王府井	1,173,302.12	2.66
48	600386	北巴传媒	1,166,913.88	2.64
49	600251	冠农股份	1,155,364.00	2.62
50	601117	中国化学	1,148,140.00	2.60
51	002393	力生制药	1,147,448.88	2.60
52	601801	皖新传媒	1,141,259.00	2.59
53	600064	南京高科	1,136,983.00	2.58
54	600056	中国医药	1,134,074.00	2.57
55	600831	广电网络	1,133,035.18	2.57
56	600809	山西汾酒	1,123,671.02	2.55
57	000156	华数传媒	1,117,007.00	2.53
58	601601	中国太保	1,106,809.10	2.51
59	300251	光线传媒	1,103,062.00	2.50
60	000878	云南铜业	1,102,001.33	2.50
61	600780	通宝能源	1,077,907.00	2.44
62	601857	中国石油	1,074,256.00	2.43
63	600694	大商股份	1,056,499.00	2.39
64	601789	宁波建工	1,053,289.00	2.39
65	002275	桂林三金	1,049,658.20	2.38
66	600153	建发股份	1,038,719.70	2.35
67	601808	中海油服	1,035,063.00	2.35
68	000600	建投能源	1,031,849.00	2.34
69	600322	天房发展	1,031,244.76	2.34
70	000423	东阿阿胶	1,030,656.00	2.34

71	601989	中国重工	1,028,011.00	2.33
72	600298	安琪酵母	1,027,925.00	2.33
73	002238	天威视讯	1,023,747.95	2.32
74	601137	博威合金	1,023,344.34	2.32
75	002001	新 和 成	1,016,808.50	2.30
76	600048	保利地产	1,016,603.00	2.30
77	000651	格力电器	1,006,058.12	2.28
78	600467	好当家	999,483.00	2.27
79	600578	京能电力	993,693.00	2.25
80	000002	万 科A	991,713.00	2.25
81	600166	福田汽车	990,516.00	2.25
82	002400	省广股份	987,461.00	2.24
83	600811	东方集团	980,873.00	2.22
84	600028	中国石化	979,394.00	2.22
85	002309	中利科技	971,011.23	2.20
86	000543	皖能电力	961,762.00	2.18
87	600383	金地集团	960,609.00	2.18
88	601126	四方股份	958,428.00	2.17
89	600373	中文传媒	938,527.57	2.13
90	000951	中国重汽	937,764.43	2.13
91	000063	中兴通讯	935,760.00	2.12
92	601006	大秦铁路	934,679.00	2.12
93	000850	华茂股份	932,670.00	2.11
94	000338	潍柴动力	930,351.00	2.11
95	600104	上汽集团	925,630.00	2.10
96	300133	华策影视	921,587.44	2.09
97	000926	福星股份	920,594.00	2.09
98	000823	超声电子	918,830.00	2.08
99	601766	中国中车	914,614.72	2.07
100	600128	弘业股份	914,215.00	2.07
101	601928	凤凰传媒	906,557.00	2.05
102	000725	京东方A	905,359.00	2.05
103	600089	特变电工	901,669.00	2.04
104	600027	华电国际	892,000.00	2.02
105	600875	东方电气	888,464.00	2.01
106	600031	三一重工	888,128.62	2.01

107	600880	博瑞传播	886,451.00	2.01
108	000726	鲁　泰Ａ	885,547.00	2.01
109	600761	安徽合力	885,525.00	2.01

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	000001	平安银行	2,896,133.97	6.56
2	601166	兴业银行	2,652,439.91	6.01
3	000776	广发证券	2,467,327.68	5.59
4	601328	交通银行	2,304,470.55	5.22
5	600551	时代出版	2,275,989.86	5.16
6	601318	中国平安	2,271,750.94	5.15
7	601939	建设银行	1,800,628.51	4.08
8	600546	山煤国际	1,626,981.88	3.69
9	600362	江西铜业	1,609,561.07	3.65
10	601998	中信银行	1,578,934.62	3.58
11	601088	中国神华	1,565,706.98	3.55
12	601098	中南传媒	1,564,698.79	3.55
13	000751	锌业股份	1,562,394.61	3.54
14	601886	江河创建	1,524,195.34	3.45
15	600000	浦发银行	1,495,905.22	3.39
16	601186	中国铁建	1,487,372.90	3.37
17	601168	西部矿业	1,441,508.16	3.27
18	002445	中南重工	1,412,504.80	3.20
19	000858	五 粮 液	1,408,147.56	3.19
20	601009	南京银行	1,406,434.07	3.19
21	601668	中国建筑	1,403,191.91	3.18
22	600216	浙江医药	1,397,691.25	3.17
23	601607	上海医药	1,397,244.45	3.17
24	002142	宁波银行	1,390,974.32	3.15
25	600386	北巴传媒	1,381,216.64	3.13
26	000869	张　裕Ａ	1,351,973.19	3.06
27	601169	北京银行	1,337,328.94	3.03
28	601398	工商银行	1,328,035.93	3.01
29	600812	华北制药	1,326,616.50	3.01

30	600015	华夏银行	1,325,736.13	3.00
31	600036	招商银行	1,322,839.03	3.00
32	600757	长江传媒	1,317,316.72	2.99
33	600859	王府井	1,297,062.08	2.94
34	600488	天药股份	1,292,240.52	2.93
35	000623	吉林敖东	1,286,571.51	2.92
36	601288	农业银行	1,260,646.80	2.86
37	000848	承德露露	1,252,538.52	2.84
38	600252	中恒集团	1,250,683.61	2.83
39	600016	民生银行	1,250,118.56	2.83
40	601808	中海油服	1,241,629.75	2.81
41	600199	金种子酒	1,227,287.08	2.78
42	000688	建新矿业	1,221,282.31	2.77
43	601818	光大银行	1,217,007.78	2.76
44	600067	冠城大通	1,202,713.49	2.73
45	002238	天威视讯	1,199,763.16	2.72
46	600251	冠农股份	1,199,749.24	2.72
47	600997	开滦股份	1,194,405.99	2.71
48	601117	中国化学	1,189,918.83	2.70
49	600322	天房发展	1,187,779.89	2.69
50	600467	好当家	1,178,160.91	2.67
51	600064	南京高科	1,168,829.67	2.65
52	601137	博威合金	1,160,294.79	2.63
53	600037	歌华有线	1,153,876.92	2.62
54	601601	中国太保	1,140,875.55	2.59
55	600048	保利地产	1,135,864.01	2.57
56	601929	吉视传媒	1,130,081.78	2.56
57	000963	华东医药	1,120,516.32	2.54
58	002393	力生制药	1,120,203.43	2.54
59	000402	金 融 街	1,117,165.59	2.53
60	600056	中国医药	1,112,901.29	2.52
61	002090	金智科技	1,098,977.89	2.49
62	600694	大商股份	1,094,467.22	2.48
63	600831	广电网络	1,094,376.71	2.48
64	600153	建发股份	1,093,672.12	2.48
65	002292	奥飞动漫	1,088,768.41	2.47
66	002275	桂林三金	1,081,310.87	2.45
67	600809	山西汾酒	1,079,620.23	2.45

68	600028	中国石化	1,075,497.60	2.44
69	600383	金地集团	1,073,204.60	2.43
70	600811	东方集团	1,070,919.77	2.43
71	601801	皖新传媒	1,070,599.67	2.43
72	600128	弘业股份	1,066,483.42	2.42
73	600780	通宝能源	1,066,171.87	2.42
74	002300	太阳电缆	1,062,249.71	2.41
75	600523	贵航股份	1,047,275.93	2.37
76	000423	东阿阿胶	1,046,707.66	2.37
77	600166	福田汽车	1,046,232.34	2.37
78	000002	万　科Ａ	1,045,290.34	2.37
79	600373	中文传媒	1,043,765.75	2.37
80	600377	宁沪高速	1,042,869.23	2.36
81	000063	中兴通讯	1,042,734.96	2.36
82	601766	中国中车	1,041,111.17	2.36
83	600350	山东高速	1,039,819.38	2.36
84	000651	格力电器	1,034,980.33	2.35
85	600280	中央商场	1,024,185.28	2.32
86	601989	中国重工	1,021,348.34	2.31
87	002001	新 和 成	1,011,233.15	2.29
88	600298	安琪酵母	1,010,747.80	2.29
89	600050	中国联通	1,009,967.64	2.29
90	600578	京能电力	1,008,292.40	2.29
91	000600	建投能源	1,004,169.42	2.28
92	002400	省广股份	1,003,142.51	2.27
93	600105	永鼎股份	998,270.55	2.26
94	002042	华孚色纺	996,963.25	2.26
95	000338	潍柴动力	996,394.49	2.26
96	601006	大秦铁路	994,978.80	2.26
97	601857	中国石油	990,020.68	2.24
98	000759	中百集团	988,707.92	2.24
99	000823	超声电子	987,508.08	2.24
100	000156	华数传媒	980,695.32	2.22
101	600345	长江通信	980,188.17	2.22
102	600724	宁波富达	977,965.96	2.22
103	601126	四方股份	977,261.99	2.22
104	600020	中原高速	976,910.76	2.21
105	000798	中水渔业	976,613.21	2.21

106	600089	特变电工	970,472.41	2.20
107	002567	唐人神	970,269.84	2.20
108	000533	万 家 乐	955,775.69	2.17
109	600548	深高速	936,822.83	2.12
110	000878	云南铜业	932,253.77	2.11
111	300251	光线传媒	931,615.34	2.11
112	300102	乾照光电	928,841.37	2.11
113	000951	中国重汽	926,844.64	2.10
114	600637	东方明珠	925,901.53	2.10
115	000543	皖能电力	923,611.61	2.09
116	002309	中利科技	922,901.03	2.09
117	600353	旭光股份	922,103.14	2.09
118	000966	长源电力	919,145.77	2.08
119	600011	华能国际	918,083.78	2.08
120	002668	奥马电器	916,987.21	2.08
121	002062	宏润建设	909,541.98	2.06
122	600823	世茂股份	904,098.75	2.05
123	600785	新华百货	900,890.59	2.04
124	002338	奥普光电	900,781.69	2.04
125	300252	金信诺	899,587.15	2.04
126	600027	华电国际	898,445.69	2.04
127	600104	上汽集团	895,073.44	2.03
128	000157	中联重科	894,660.21	2.03
129	000926	福星股份	893,795.63	2.03
130	600197	伊力特	892,211.15	2.02

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	459,056,075.56
卖出股票收入（成交）总额	410,781,588.52

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序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序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	24,123.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,007.38
5	应收申购款	345,159.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	372,290.36

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000688	建新矿业	449,726.22	0.35	重大事项
2	002194	武汉凡谷	374,779.18	0.29	重大事项
3	600978	宜华木业	334,109.16	0.26	重大事项
4	000566	海南海药	330,801.40	0.26	重大事项
5	002308	威创股份	313,503.00	0.25	重大事项
6	000066	长城电脑	304,317.12	0.24	重大事项
7	002018	华信国际	302,521.04	0.24	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601789	宁波建工	452,779.20	0.36	重大事项
2	600641	万业企业	329,701.57	0.26	重大事项
3	002445	中南重工	312,698.00	0.25	重大事项
4	300360	炬华科技	299,744.00	0.24	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§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

	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
中证 800A	324	125,144.14	31,993,794.00	78.91%	8,552,907.00	21.09%
中证 800B	2,047	19,807.87	30,090.00	0.07%	40,516,611.00	99.93%
800 分级	2,611	25,755.72	8,137,746.66	12.10%	59,110,434.06	87.90%
合计	4,982	29,775.51	40,161,630.66	27.07%	108,179,952.06	72.93%

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

中证 800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中华联合财产保险股份有限公司－传统保险产品	21,269,977.00	52.46%
2	太平资产－工商银行－太平之星 20 号投资产品	7,767,338.00	19.16%
3	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）－鼎锋另类策略 2 期证券投资基金	1,000,000.00	2.47%
4	黄国柱	969,670.00	2.39%
5	姜凤伶	707,492.00	1.74%
6	富安达基金－光大银行－富安达－利可 1 号资产管理计划	641,051.00	1.58%
7	西南证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	580,000.00	1.43%
8	陈均连	529,408.00	1.31%
9	泰康人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品-019L-CT001 深	488,700.00	1.21%
10	吴汉彬	477,300.00	1.18%

中证 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄志强	1,372,900.00	3.39%
2	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	943,401.00	2.33%
3	阮文君	920,000.00	2.27%
4	周东彪	690,000.00	1.70%
5	张宏玉	450,700.00	1.11%
6	李超英	440,000.00	1.09%

7	游俊杰	400,000.00	0.99%
8	赵仲杰	394,400.00	0.97%
9	李志江	370,000.00	0.91%
10	胡艳云	329,800.00	0.81%

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。

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	中证 800A	-	-
	中证 800B	-	-
	800 分级	272,590.30	0.41%
	合计	272,590.30	0.18%

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，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中证 800A	0
	中证 800B	0
	800 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中证 800A	0
	中证 800B	0
	800 分级	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日（2013 年 11 月 5 日）基金份额总额	-	-	458,328,703.92
本报告期期初基金份额总额	2,152,169.00	2,152,169.00	28,270,868.26
本报告期基金总申购份额	-	-	418,691,939.36

减:本报告期基金总赎回份额	-	-	357,169,264.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	38,394,532.00	38,394,532.00	-22,545,362.27
本报告期期末基金份额总额	40,546,701.00	40,546,701.00	67,248,180.72

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和不定期折算份额。

§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

本基金管理人于2015年6月10日发布公告，凌宇翔先生自2015年6月8日起担任本基金管理人副总经理，代为履行督察长职务。

本基金管理人于2015年7月25日发布公告，自2015年7月24日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长，凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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师事务所。

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	
方正证券股份有限公司	4	868,895,807.32	100.00%	791,043.57	100.00%	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	3	-	-	-	-	-

股份有限公司						
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
航空证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增 1 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：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

银华基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日