

# 银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 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。

基金托管人中国建设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。

## 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
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	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的真实、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>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47

7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	银华沪深 300 指数分级		
场内简称	300 分级		
基金主代码	161811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 1 月 7 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	296,421,011.47 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	2014-01-21		
下属分级基金的基金简称	银华 300A	银华 300B	300 分级
下属分级基金的交易代码	150167	150168	161811
报告期末下属分级基金份额总额	86,476,920.00 份	86,476,920.00 份	123,467,171.47 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 300”变更为“300 分级”。

### 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	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托银华量化投资平台，使用组合优化方法创建投资组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。 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%—100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；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%×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。从本基金所分拆的两类基金份额来看，银华 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华 300B 份额具有高风险、高预期收

	益的特征。		
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	田青
	联系电话	(010)58163000	(010) 67595096
	电子邮箱	yhj@yhfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
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		王珠林	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

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	140,422,671.05
本期利润	134,370,940.11
加权平均基金份额本期利润	0.2795
本期加权平均净值利润率	25.19%

本期基金份额净值增长率	22.81%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
期末可供分配利润	33,126,954.36
期末可供分配基金份额利润	0.1118
期末基金资产净值	354,309,396.31
期末基金份额净值	1.195
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	83.97%

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

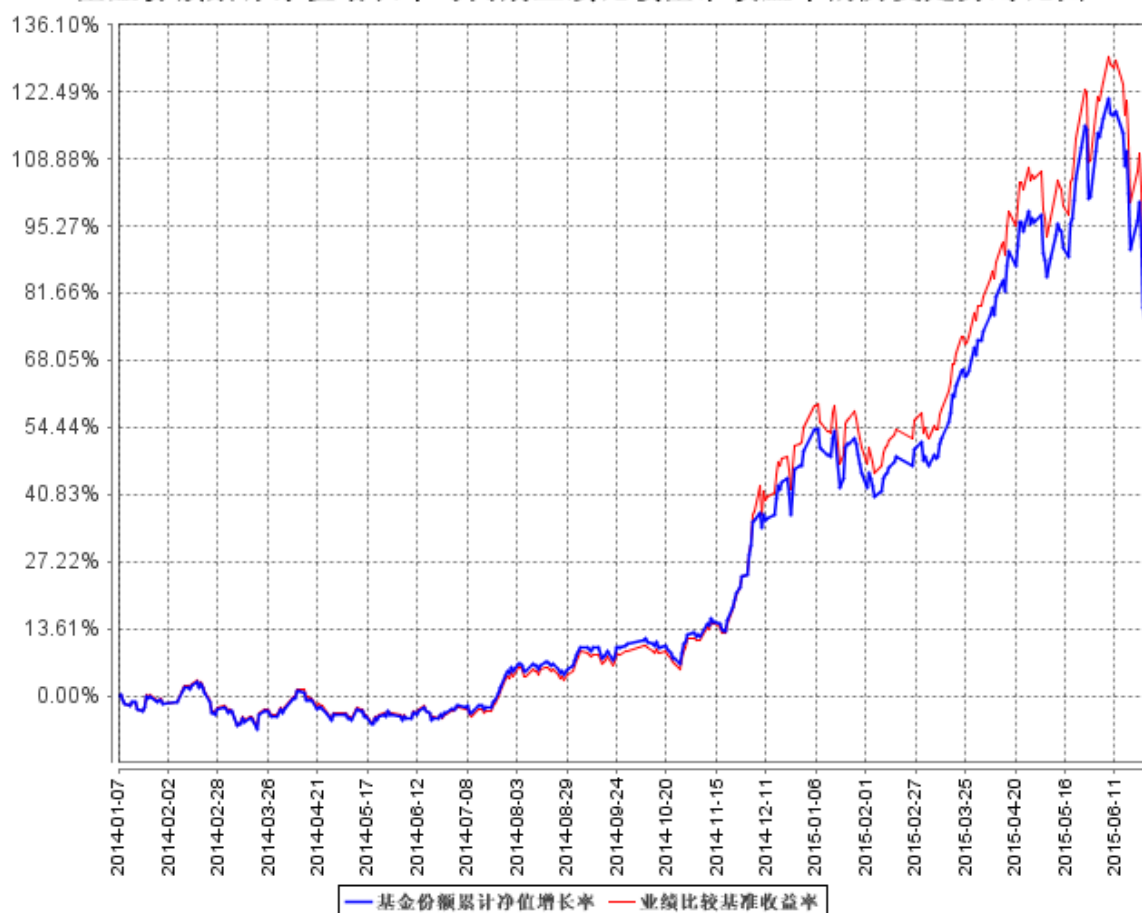
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.50%	3.37%	-7.18%	3.32%	-1.32%	0.05%
过去三个月	8.74%	2.53%	9.98%	2.48%	-1.24%	0.05%
过去六个月	22.81%	2.17%	25.29%	2.15%	-2.48%	0.02%
过去一年	89.26%	1.71%	99.67%	1.75%	-10.41%	-0.04%
自基金合同生效起至今	83.97%	1.51%	93.51%	1.55%	-9.54%	-0.04%

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%X 沪深 300 指数+5%X 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：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起三个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定：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%-100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成分股和备选成分股的资产不低于非现金资产的 90%；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		

周大鹏 先生	本基金的基 金经理	2014年1月7 日	-	5.5 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，自2012年8月23日起兼任上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2012年8月29日起兼任银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2013年5月22日起兼任银华中证成长股债恒定组合30/70指数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之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、《银华沪深 300 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 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**

上半年，股市波动较为剧烈。经济增速进一步放缓，企业整体盈利增速进一步下降，政府出台了一些列稳增长的政策。但是实体经济投资收益率在低位徘徊、房地产市场的软着陆、股市的赚钱效应，促使居民的资产配置向股市转移。居民资金的转移和股市的上涨形成了正反馈。这种正反馈在加杠杆后变得异常强烈。监管层的去杠杆措施打破这种正反馈，股市短期出现了较大回调。

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 1.195 元，本报告期份额净值增长率为 22.81%，同期业绩比较基准收益率为 25.29%。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 2015 年下半年，我们对市场持谨慎乐观的态度。

世界经济缓慢复苏，但是除美国外复苏的基础并不牢固。出口面临的国际环境可能略有改善，但是回升幅度有限，我们预计出口将呈现低速增长。人口老龄化的趋势限制了房地产行业的市场空间，我们预计房地产投资将低速增长。中央对地方存量债务的债务置换等行为，使得地方政府

更有能力进行基建投资。以“一带一路”为核心的国际化投资逐步进入落实阶段。国际投资和国内开发相结合，有望成为稳定经济增长的重要手段。向知识经济转型的背景下，人力资本的重要性逐渐提升，消费增长有望提速。综合以上因素，我们对市场持谨慎乐观的态度。

#### 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

根据银华沪深 300 指数分级证券投资基金合同的约定，本基金（包括 300 分级份额、银华 300A 份额、银华 300B 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华沪深 300 指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	22,965,287.67	34,577,617.74
结算备付金		46,941.85	195,761.33
存出保证金		354,510.09	33,833.60
交易性金融资产	6.4.7.2	335,943,744.60	429,621,114.59
其中：股票投资		335,943,744.60	429,621,114.59
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		6,262,078.97	3,911,344.10
应收利息	6.4.7.5	5,289.18	10,902.94
应收股利		-	-
应收申购款		709,846.41	1,157,297.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		366,287,698.77	469,507,872.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 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		10,793,714.17	14,205,103.60
应付管理人报酬		358,208.06	455,469.46
应付托管费		78,805.79	100,203.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	424,174.38	842,812.11
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	323,400.06	247,740.15
负债合计		11,978,302.46	15,851,328.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	276,633,810.98	435,084,924.61
未分配利润	6.4.7.10	77,675,585.33	18,571,619.03
所有者权益合计		354,309,396.31	453,656,543.64
负债和所有者权益总计		366,287,698.77	469,507,872.24

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，300 分级份额净值为人民币 1.195 元，银华 300A 份额净值为人民币 1.029 元，银华 300B 份额净值为人民币 1.361 元；基金份额总额为 296,421,011.47 份，其中 300 分级份额为 123,467,171.47 份，银华 300A 份额为 86,476,920.00 份，银华 300B 份额为 86,476,920.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华沪深 300 指数分级证券投资基金

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 7 日(基金 合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		139,466,188.50	-4,813,573.45
1.利息收入		154,107.34	65,363.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	154,107.34	65,363.78
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）		144,780,902.56	-3,670,454.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	142,043,574.60	-6,281,798.14
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	2,737,327.96	2,611,343.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,051,730.94	-1,252,777.29
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	582,909.54	44,294.48
<b>减：二、费用</b>		5,095,248.39	1,873,733.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,635,570.46	1,117,900.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	579,825.51	245,938.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,558,871.83	240,945.54
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	320,980.59	268,949.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		134,370,940.11	-6,687,307.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		134,370,940.11	-6,687,307.40

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华沪深 300 指数分级证券投资基金

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）	435,084,924.61	18,571,619.03	453,656,543.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	134,370,940.11	134,370,940.11
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）	-158,451,113.63	-75,266,973.81	-233,718,087.44

其中：1.基金申购款	376,833,164.94	34,599,677.60	411,432,842.54
2.基金赎回款	-535,284,278.57	-109,866,651.41	-645,150,929.98
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）	276,633,810.98	77,675,585.33	354,309,396.31
项目	上年度可比期间 2014年1月7日(基金合同生效日)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）	359,021,612.58	-109,080,388.88	249,941,223.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,687,307.40	-6,687,307.40
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）	-32,284,368.27	10,165,486.02	-22,118,882.25
其中：1.基金申购款	42,371,714.46	-13,140,089.17	29,231,625.29
2.基金赎回款	-74,656,082.73	23,305,575.19	-51,350,507.54
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）	326,737,244.31	-105,602,210.26	221,135,034.05

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

银华沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议备案的回函》（证监许可字



[2013]1061 号), 银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)终止上市, 采用分级运作, 并修订基金合同。自 2014 年 1 月 7 日起, 《银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效且《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》生效, 同时“银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)”更名为“银华沪深 300 指数分级证券投资基金”。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。于基金合同生效日, 本基金规模为 249, 941, 223. 01 份基金份额。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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额(即“300 分级份额”)、银华沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“银华 300A 份额”)与银华沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“银华 300B 份额”)。其中, 银华 300A 份额、银华 300B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。基金管理人进行分级运作起始折算, 将在分级运作起始折算基准日登记在册的 300 分级份额, 以折算前的基金份额净值为基础, 折算成基金份额净值为 1.00 元的 300 分级份额, 300 分级份额数按折算比例相应调整。在基金合同生效日, 在分级运作自动分离日对折算后的场内 300 分级份额按照 1:1 的比例自动分离为银华 300A 份额和银华 300B 份额。基金合同生效后, 300 分级份额保留原有基金代码, 只可以进行场内与场外的申购和赎回, 但不上市交易。银华 300A 份额与银华 300B 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。

在银华 300A 份额、300 分级份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日, 本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日, 第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日。银华 300A 份额和银华 300B 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 300A 份额的应得收益进行定期份额折算, 每 2 份 300 分级份额将按 1 份银华 300A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于银华 300A 份额期末的约定应得收益, 即银华 300A 份额每个定期折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分, 将折算为场内 300 分级份额分配给银华 300A 份额持有人。300 分级份额持有人持有的每 2 份 300 分级份额将按 1 份银华 300A 份额获得新增 300 分级份额的分配。持有场外 300 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外 300 分级份额的分配; 持有场内 300 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内 300 分级份额的分配。经过上述份额折算, 银华 300A 份额和 300 分级份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度 12 月第一个工作日为基金份额折算基准日, 本基金将对银华 300A 份额和 300 分级份额进行定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当 300 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上；当银华 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元及以下。在份额折算期间的份额净值计算保留小数位以份额折算相关公告为准。

当 300 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上后，本基金将分别对银华 300A 份额、银华 300B 份额和 300 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华 300A 份额和银华 300B 份额的比例为 1:1，份额折算后银华 300A 份额、银华 300B 份额的基金份额参考净值和 300 分级份额的基金份额净值均调整为 1 元。当银华 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元及以下后，本基金将分别对银华 300A 份额、银华 300B 份额和 300 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华 300A 份额和银华 300B 份额的比例为 1:1，份额折算后 300 分级份额的基金份额净值、银华 300A 份额和银华 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。

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（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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%—100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，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： $95\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+5\% \times$  商业银行活期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### **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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

除 6.4.5.2 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。

#### **6.4.4.1 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。

### **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。

#### **6.4.5.3 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**

#### **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》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。

#### 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》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[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。

#### 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》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、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》的规定，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》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》的规定，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。

## 6.4.7 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	22,965,287.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	22,965,287.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	259,892,520.20	335,943,744.60	76,051,224.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
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	259,892,520.20	335,943,744.60	76,051,224.40

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,066.14
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	21.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	42.34
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	159.50
合计	5,289.18

**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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	424,174.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	424,174.38

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,123.13
预提费用	253,313.68
指数使用费	50,000.00
其他	3,963.25
合计	323,400.06

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	310,063,336.90	435,084,924.61
本期申购	3,557,679.74	4,993,080.99
本期赎回(以“-”号填列)	-12,813,058.93	-17,982,142.48
2015 年 1 月 6 日 基金拆分/份额折算前	300,807,957.71	422,095,863.12
基金拆分/份额折算变动份额	151,445,651.29	-
本期申购	398,449,691.56	371,840,083.95
本期赎回(以“-”号填列)	-554,282,289.09	-517,302,136.09
本期末	296,421,011.47	276,633,810.98

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和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2015 年 1 月 6 日为份额折算基准日，对 300 分级份额以及银华 300A 份额实施了不定期份额折算；

(2) 根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回 300 分级份额，银华 300A 份额和银华 300B 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 300A 份额和银华 300B 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	-105,709,171.96	124,280,790.99	18,571,619.03
本期利润	140,422,671.05	-6,051,730.94	134,370,940.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,586,544.73	-73,680,429.08	-75,266,973.81
其中：基金申购款	-79,323,255.87	113,922,933.47	34,599,677.60
基金赎回款	77,736,711.14	-187,603,362.55	-109,866,651.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,126,954.36	44,548,630.97	77,675,585.33

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	142,300.46
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	9,192.99
其他	2,613.89
合计	154,107.34

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	599,713,408.96
减：卖出股票成本总额	457,669,834.36
买卖股票差价收入	142,043,574.60

#### 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 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,737,327.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,737,327.96

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,051,730.94



——股票投资	-6,051,730.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-6,051,730.94

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	582,909.54
合计	582,909.54

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,558,871.83
银行间市场交易费用	-
合计	1,558,871.83

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行费用	8,266.91
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
上市费	29,752.78
其他	400.00
合计	320,980.59

## 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2014 年 1 月 7 日生效，上年度可比期间指 2014 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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 7 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西南证券	68,199,949.88	7.20%	22,363,402.51	14.58%
第一创业	24,134,125.03	2.55%	-	-

### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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
西南证券	62,090.27	7.20%	62,090.27	14.64%
第一创业	21,977.07	2.55%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年6月30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
西南证券	20,357.77	14.58%	7,368.19	11.25%

注：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和经手费后的净额列示。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。

### 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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,635,570.46	1,117,900.40
其中：支付销售机构的客户维护费	219,834.00	200,026.03

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：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

#### 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 7 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	579,825.51	245,938.07

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 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

#### 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固有资金投资本基金的情况

注：：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资银华 300A、银华 300B、300 分级基金份额。

##### 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：份

银华 300A				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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
西南证券	-	-	18.00	0.00%
第一创业	-	-	4.00	0.00%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未持有银华 300A、银华 300B、300 分级份额。对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 7 日(基金合同生效日)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
中国建设银行	22,965,287.67	142,300.46	12,754,382.17	64,220.91

#### 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在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 300 分级份额、银华 300A 份额、银华 300B 份额）不进行收益分配。

#### 6.4.12 期末（2015 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
600900	长江电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项	14.35	-	-	186,849	1,804,210.43	2,681,283.15	-
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大事项	36.50	-	-	56,260	1,152,509.09	2,053,490.00	-
600886	国投电力	2015 年 6 月 24 日	重大事项	14.87	-	-	102,434	903,399.21	1,523,193.58	-

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	74,887	634,550.81	1,150,264.32	-
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大事项	10.32	-	-	89,486	624,205.99	923,495.52	-
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	17.51	-	-	51,188	490,695.65	896,301.88	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大事项	12.96	-	-	67,865	362,876.83	879,530.40	-
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	124,413	401,130.02	870,891.00	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大事项	37.29	-	-	21,242	383,514.88	792,114.18	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项	30.81	-	-	23,760	419,111.42	732,045.60	-
000839	中信国安	2015年6月29日	重大事项	23.57	-	-	28,308	323,250.00	667,219.56	-
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	16.89	-	-	39,010	483,152.46	658,878.90	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	35.04	-	-	18,183	639,977.15	637,132.32	-
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	19,594	289,686.30	572,340.74	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	-	-	30,623	419,515.38	567,444.19	-
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	12,345	513,609.26	527,872.20	-
002310	东方园林	2015年5月27日	重大事项	38.30	-	-	13,312	249,371.48	509,849.60	-
000963	华东医药	2015年6月	重大事项	71.48	2015年8月	69.20	6,531	351,552.08	466,835.88	-

		26 日			5 日						
601021	春秋航空	2015 年 6 月 26 日	重大事项	126.09	2015 年 7 月 21 日	113.48	3,611	451,377.93	455,310.99	-	
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	18,488	188,075.77	445,006.16	-	
600277	亿利能源	2015 年 6 月 1 日	重大事项	14.62	-	-	28,250	252,811.22	413,015.00	-	
600395	盘江股份	2015 年 6 月 9 日	重大事项	15.71	2015 年 8 月 20 日	12.60	20,312	219,043.12	319,101.52	-	
002001	新和成	2015 年 6 月 30 日	重大事项	17.09	2015 年 7 月 13 日	18.49	16,383	261,848.97	279,985.47	-	
600872	中炬高新	2015 年 5 月 4 日	重大事项	23.17	-	-	9,030	137,641.71	209,225.10	-	
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	8,178	108,108.00	169,039.26	-	
000996	中国中期	2014 年 12 月 8 日	重大事项	28.60	-	-	4,500	113,844.00	128,700.00	-	
002116	中国海诚	2015 年 4 月 23 日	重大事项	19.21	2015 年 7 月 24 日	21.13	5,460	96,370.00	104,886.60	-	
300294	博雅生物	2015 年 4 月 23 日	重大事项	78.83	-	-	1,300	80,024.00	102,479.00	-	
002203	海亮股份	2015 年 4 月 27 日	重大事项	12.71	-	-	5,000	54,795.00	63,550.00	-	
000786	北新建材	2015 年 4 月 10 日	重大事项	18.58	-	-	400	7,096.00	7,432.00	-	

#### 6.4.12.3 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，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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	22,965,287.67	-	-	-	-	-	22,965,287.67
结算备付金	46,941.85	-	-	-	-	-	46,941.85
存出保证金	354,510.09	-	-	-	-	-	354,510.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	335,943,744.60	335,943,744.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,262,078.97	6,262,078.97
应收利息	-	-	-	-	-	5,289.18	5,289.18
应收申购款	107,498.44	-	-	-	-	602,347.97	709,846.41
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,474,238.05	-	-	-	-	342,813,460.72	366,287,698.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,793,714.17	10,793,714.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	358,208.06	358,208.06
应付托管费	-	-	-	-	-	78,805.79	78,805.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	424,174.38	424,174.38
其他负债	-	-	-	-	-	323,400.06	323,400.06
负债总计	-	-	-	-	-	11,978,302.46	11,978,302.46
利率敏感度缺口	23,474,238.05	-	-	-	-	330,835,158.26	354,309,396.31
上年度末 2014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	34,577,617.74	-	-	-	-	-	34,577,617.74
结算备付金	195,761.33	-	-	-	-	-	195,761.33
存出保证金	33,833.60	-	-	-	-	-	33,833.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	429,621,114.59	429,621,114.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,911,344.10	3,911,344.10

应收利息	-	-	-	-	10,902.94	10,902.94
应收申购款	173,650.12	-	-	-	983,647.82	1,157,297.94
资产总计	34,980,862.79	-	-	-	434,527,009.45	469,507,872.24
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	14,205,103.60	14,205,103.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	455,469.46	455,469.46
应付托管费	-	-	-	-	100,203.28	100,203.28
应付交易费用	-	-	-	-	842,812.11	842,812.11
其他负债	-	-	-	-	247,740.15	247,740.15
负债总计	-	-	-	-	15,851,328.60	15,851,328.60
利率敏感度缺口	34,980,862.79	-	-	-	-418,675,680.85	453,656,543.64

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：本基金在 2015 年 6 月 30 日及 2014 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。

#### 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，本基金的投资范围为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（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：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%-100%，投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 90%；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。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 2015 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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	335,943,744.60	94.82	429,621,114.59	94.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	335,943,744.60	94.82	429,621,114.59	94.70

#### 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（2014 年的 Beta 系数是自 2014 年 1 月 7 日至 2014 年 12 月 31 日期间所有交易日）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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+5%	16,965,362.37	20,249,380.53
	-5%	-16,965,362.37	-20,249,380.53

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

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	335,943,744.60	91.72
	其中：股票	335,943,744.60	91.72
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	23,012,229.52	6.28
7	其他各项资产	7,331,724.65	2.00
8	合计	366,287,698.77	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	814,218.92	0.23
B	采矿业	15,447,474.73	4.36
C	制造业	110,263,618.45	31.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,658,647.50	4.14
E	建筑业	14,892,554.67	4.20
F	批发和零售业	7,063,321.83	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	13,853,540.48	3.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,397,075.97	5.47
J	金融业	112,536,279.89	31.76
K	房地产业	14,092,341.98	3.98
L	租赁和商务服务业	3,419,780.30	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,739,498.44	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	363,279.86	0.10
R	文化、体育和娱乐业	4,007,245.55	1.13
S	综合	939,788.43	0.27
	合计	334,488,667.00	94.41

### 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	319,101.52	0.09
C	制造业	497,961.94	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,624.00	0.01
F	批发和零售业	496,503.54	0.14
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	104,886.60	0.03
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	1,455,077.60	0.41

### 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	601318	中国平安	155,268	12,722,659.92	3.59
2	600036	招商银行	473,154	8,857,442.88	2.50
3	600016	民生银行	847,254	8,421,704.76	2.38
4	600030	中信证券	225,669	6,072,752.79	1.71
5	601166	兴业银行	327,735	5,653,428.75	1.60
6	601398	工商银行	1,051,778	5,553,387.84	1.57
7	600000	浦发银行	320,873	5,442,006.08	1.54
8	600837	海通证券	238,392	5,196,945.60	1.47
9	601766	中国中车	270,013	4,957,438.68	1.40

10	601328	交通银行	562,673	4,636,425.52	1.31
11	000651	格力电器	69,001	4,409,163.90	1.24
12	000002	万科A	278,099	4,037,997.48	1.14
13	601668	中国建筑	429,985	3,573,175.35	1.01
14	601989	中国重工	238,647	3,531,975.60	1.00
15	600519	贵州茅台	13,096	3,374,184.40	0.95
16	600887	伊利股份	175,690	3,320,541.00	0.94
17	601988	中国银行	664,829	3,251,013.81	0.92
18	601169	北京银行	242,215	3,226,303.80	0.91
19	601818	光大银行	570,605	3,058,442.80	0.86
20	000783	长江证券	205,718	2,869,766.10	0.81
21	601288	农业银行	758,827	2,815,248.17	0.79
22	601601	中国太保	90,102	2,719,278.36	0.77
23	601390	中国中铁	196,018	2,683,486.42	0.76
24	600900	长江电力	186,849	2,681,283.15	0.76
25	601006	大秦铁路	170,503	2,393,862.12	0.68
26	000001	平安银行	164,091	2,385,883.14	0.67
27	000333	美的集团	60,458	2,253,874.24	0.64
28	601688	华泰证券	96,487	2,231,744.31	0.63
29	300059	东方财富	34,926	2,203,481.34	0.62
30	600048	保利地产	189,678	2,166,122.76	0.61
31	600104	上汽集团	94,810	2,142,706.00	0.60
32	600028	中国石化	301,438	2,128,152.28	0.60
33	600637	东方明珠	49,388	2,078,247.04	0.59
34	000166	申万宏源	127,784	2,076,490.00	0.59
35	000024	招商地产	56,260	2,053,490.00	0.58
36	002024	苏宁云商	130,417	1,995,380.10	0.56
37	000776	广发证券	87,192	1,974,898.80	0.56
38	600795	国电电力	281,630	1,962,961.10	0.55
39	600015	华夏银行	127,667	1,941,815.07	0.55
40	600050	中国联通	249,677	1,830,132.41	0.52
41	600999	招商证券	68,423	1,810,472.58	0.51
42	600011	华能国际	123,636	1,734,613.08	0.49
43	000858	五粮液	54,418	1,725,050.60	0.49
44	000768	中航飞机	39,167	1,706,897.86	0.48
45	601377	兴业证券	122,532	1,677,463.08	0.47
46	600570	恒生电子	14,562	1,631,672.10	0.46
47	600518	康美药业	90,645	1,607,135.85	0.45
48	601857	中国石油	139,270	1,577,929.10	0.45

49	002415	海康威视	35,008	1,568,358.40	0.44
50	600705	中航资本	65,926	1,526,186.90	0.43
51	600886	国投电力	102,434	1,523,193.58	0.43
52	000725	京东方 A	291,940	1,515,168.60	0.43
53	600029	南方航空	103,718	1,508,059.72	0.43
54	600276	恒瑞医药	33,661	1,499,260.94	0.42
55	601628	中国人寿	47,761	1,495,874.52	0.42
56	600010	包钢股份	287,514	1,492,197.66	0.42
57	601336	新华保险	23,917	1,460,372.02	0.41
58	600109	国金证券	59,695	1,456,558.00	0.41
59	601901	方正证券	121,212	1,441,210.68	0.41
60	000100	TCL 集团	251,424	1,420,545.60	0.40
61	601899	紫金矿业	271,811	1,391,672.32	0.39
62	000069	华侨城 A	106,994	1,388,782.12	0.39
63	601186	中国铁建	88,217	1,378,831.71	0.39
64	000063	中兴通讯	57,877	1,378,051.37	0.39
65	300104	乐视网	26,533	1,373,348.08	0.39
66	000625	长安汽车	64,718	1,368,785.70	0.39
67	601669	中国电建	118,187	1,340,240.58	0.38
68	600690	青岛海尔	43,674	1,324,632.42	0.37
69	601009	南京银行	57,950	1,321,260.00	0.37
70	601727	上海电气	87,027	1,299,313.11	0.37
71	600703	三安光电	41,171	1,288,652.30	0.36
72	002450	康得新	42,091	1,287,984.60	0.36
73	000538	云南白药	14,928	1,287,838.56	0.36
74	000728	国元证券	33,799	1,283,686.02	0.36
75	600019	宝钢股份	141,664	1,238,143.36	0.35
76	600115	东方航空	100,199	1,234,451.68	0.35
77	600585	海螺水泥	57,340	1,229,943.00	0.35
78	600415	小商品城	78,012	1,192,023.36	0.34
79	601088	中国神华	56,734	1,182,903.90	0.33
80	601600	中国铝业	125,676	1,172,557.08	0.33
81	600111	北方稀土	64,167	1,163,989.38	0.33
82	601111	中国国航	74,887	1,150,264.32	0.32
83	600089	特变电工	76,326	1,130,388.06	0.32
84	601919	中国远洋	89,936	1,122,401.28	0.32
85	000338	潍柴动力	34,720	1,099,235.20	0.31
86	600100	同方股份	52,359	1,099,015.41	0.31
87	600031	三一重工	112,110	1,086,345.90	0.31

88	600221	海南航空	169,300	1,081,827.00	0.31
89	600839	四川长虹	108,761	1,070,208.24	0.30
90	600583	海油工程	63,393	1,056,127.38	0.30
91	600271	航天信息	16,303	1,054,967.13	0.30
92	600150	中国船舶	20,282	1,044,523.00	0.29
93	300024	机器人	13,498	1,042,855.48	0.29
94	000503	海虹控股	21,189	1,038,261.00	0.29
95	000157	中联重科	125,936	1,021,340.96	0.29
96	601618	中国中冶	139,614	1,009,409.22	0.28
97	601018	宁波港	113,103	999,830.52	0.28
98	000402	金融街	70,428	995,147.64	0.28
99	600118	中国卫星	17,408	991,559.68	0.28
100	002142	宁波银行	46,597	985,526.55	0.28
101	600804	鹏博士	32,803	979,497.58	0.28
102	300027	华谊兄弟	25,620	977,146.80	0.28
103	600196	复星医药	33,724	975,972.56	0.28
104	600256	广汇能源	92,249	959,389.60	0.27
105	600535	天士力	19,105	950,664.80	0.27
106	600352	浙江龙盛	67,066	950,325.22	0.27
107	600340	华夏幸福	31,168	949,065.60	0.27
108	600588	用友网络	20,666	948,156.08	0.27
109	601099	太平洋	72,773	940,227.16	0.27
110	002673	西部证券	32,938	934,451.06	0.26
111	601106	中国一重	77,010	932,591.10	0.26
112	600068	葛洲坝	79,170	925,497.30	0.26
113	000630	铜陵有色	89,486	923,495.52	0.26
114	002736	国信证券	36,229	908,985.61	0.26
115	002304	洋河股份	12,965	899,252.40	0.25
116	600153	建发股份	51,188	896,301.88	0.25
117	601866	中海集运	93,442	887,699.00	0.25
118	600406	国电南瑞	42,879	887,166.51	0.25
119	002202	金风科技	45,244	880,900.68	0.25
120	600739	辽宁成大	36,019	880,664.55	0.25
121	000778	新兴铸管	67,865	879,530.40	0.25
122	600009	上海机场	27,626	875,744.20	0.25
123	002230	科大讯飞	24,965	872,277.10	0.25
124	000709	河北钢铁	124,413	870,891.00	0.25
125	600958	东方证券	30,281	866,642.22	0.24
126	600177	雅戈尔	45,924	838,572.24	0.24



127	600383	金地集团	66,099	836,152.35	0.24
128	600005	武钢股份	118,882	835,740.46	0.24
129	601333	广深铁路	99,862	820,865.64	0.23
130	000423	东阿阿胶	15,004	817,718.00	0.23
131	002241	歌尔声学	22,487	807,283.30	0.23
132	600066	宇通客车	39,156	804,655.80	0.23
133	000039	中集集团	24,729	798,746.70	0.23
134	601555	东吴证券	38,699	792,168.53	0.22
135	002292	奥飞动漫	21,242	792,114.18	0.22
136	600674	川投能源	63,123	789,668.73	0.22
137	600023	浙能电力	77,979	773,551.68	0.22
138	600309	万华化学	31,846	770,036.28	0.22
139	300070	碧水源	15,767	769,271.93	0.22
140	601800	中国交建	43,767	768,548.52	0.22
141	601888	中国国旅	11,504	762,715.20	0.22
142	002594	比亚迪	13,778	760,958.94	0.21
143	002465	海格通信	23,491	756,175.29	0.21
144	600649	城投控股	53,524	751,476.96	0.21
145	000559	万向钱潮	33,785	738,540.10	0.21
146	000917	电广传媒	23,760	732,045.60	0.21
147	002081	金螳螂	25,949	731,502.31	0.21
148	000060	中金岭南	39,114	727,129.26	0.21
149	600085	同仁堂	20,180	724,663.80	0.20
150	600875	东方电气	35,266	721,895.02	0.20
151	002008	大族激光	24,866	714,151.52	0.20
152	000623	吉林敖东	21,073	708,052.80	0.20
153	601998	中信银行	91,492	705,403.32	0.20
154	601991	大唐发电	88,303	704,657.94	0.20
155	600398	海澜之家	38,642	700,579.46	0.20
156	600863	内蒙华电	85,478	699,210.04	0.20
157	601933	永辉超市	59,883	694,043.97	0.20
158	000750	国海证券	40,812	685,641.60	0.19
159	600157	永泰能源	98,871	680,232.48	0.19
160	600027	华电国际	60,978	678,075.36	0.19
161	000629	攀钢钒钛	126,417	677,595.12	0.19
162	600688	上海石化	62,875	674,648.75	0.19
163	600642	申能股份	66,996	670,629.96	0.19
164	002500	山西证券	37,066	670,523.94	0.19
165	300017	网宿科技	14,386	667,798.12	0.19

166	000839	中信国安	28,308	667,219.56	0.19
167	300124	汇川技术	13,823	663,504.00	0.19
168	000793	华闻传媒	39,010	658,878.90	0.19
169	000568	泸州老窖	20,106	655,656.66	0.19
170	002065	东华软件	22,486	646,472.50	0.18
171	002353	杰瑞股份	18,183	637,132.32	0.18
172	600741	华域汽车	29,618	632,344.30	0.18
173	300058	蓝色光标	39,973	631,973.13	0.18
174	601607	上海医药	28,308	630,419.16	0.18
175	600252	中恒集团	27,282	627,486.00	0.18
176	000895	双汇发展	29,178	622,366.74	0.18
177	601179	中国西电	60,353	618,618.25	0.17
178	601898	中煤能源	53,898	615,515.16	0.17
179	002456	欧菲光	18,203	614,169.22	0.17
180	601168	西部矿业	56,138	613,026.96	0.17
181	000009	中国宝安	37,497	611,576.07	0.17
182	000800	一汽轿车	24,030	597,866.40	0.17
183	600663	陆家嘴	11,991	596,432.34	0.17
184	002385	大北农	44,088	596,069.76	0.17
185	000876	新希望	30,676	595,421.16	0.17
186	600018	上港集团	75,026	593,455.66	0.17
187	000046	泛海控股	40,259	589,794.35	0.17
188	000826	桑德环境	14,951	581,444.39	0.16
189	600660	福耀玻璃	40,204	574,113.12	0.16
190	600873	梅花生物	54,859	572,727.96	0.16
191	002375	亚厦股份	19,594	572,340.74	0.16
192	601117	中国化学	58,104	568,257.12	0.16
193	000878	云南铜业	30,623	567,444.19	0.16
194	002146	荣盛发展	44,943	561,787.50	0.16
195	600489	中金黄金	43,325	557,592.75	0.16
196	600208	新湖中宝	71,875	554,875.00	0.16
197	000425	徐工机械	41,710	553,491.70	0.16
198	600060	海信电器	22,489	553,004.51	0.16
199	002236	大华股份	17,241	550,332.72	0.16
200	600718	东软集团	25,306	549,899.38	0.16
201	000883	湖北能源	63,013	549,473.36	0.16
202	600332	白云山	15,773	543,537.58	0.15
203	600372	中航电子	15,529	542,427.97	0.15
204	002129	中环股份	27,057	535,458.03	0.15

205	300002	神州泰岳	35,118	535,198.32	0.15
206	000792	盐湖股份	18,733	531,642.54	0.15
207	601633	长城汽车	12,345	527,872.20	0.15
208	000581	威孚高科	17,013	527,232.87	0.15
209	600362	江西铜业	24,431	525,510.81	0.15
210	601258	庞大集团	95,408	520,927.68	0.15
211	000970	中科三环	25,114	517,599.54	0.15
212	600547	山东黄金	20,946	517,366.20	0.15
213	002252	上海莱士	7,902	517,106.88	0.15
214	600867	通化东宝	23,350	512,065.50	0.14
215	002310	东方园林	13,312	509,849.60	0.14
216	000061	农产品	24,972	509,428.80	0.14
217	000598	兴蓉投资	52,734	504,664.38	0.14
218	002475	立讯精密	14,704	497,142.24	0.14
219	600170	上海建工	52,482	492,281.16	0.14
220	000413	东旭光电	49,715	486,212.70	0.14
221	601098	中南传媒	21,159	484,752.69	0.14
222	601225	陕西煤业	58,863	481,499.34	0.14
223	600600	青岛啤酒	10,246	477,361.14	0.13
224	600108	亚盛集团	45,839	474,892.04	0.13
225	601808	中海油服	16,973	474,225.62	0.13
226	002153	石基信息	3,640	473,163.60	0.13
227	600827	百联股份	22,717	472,740.77	0.13
228	000963	华东医药	6,531	466,835.88	0.13
229	002410	广联达	19,939	466,572.60	0.13
230	000712	锦龙股份	13,276	465,987.60	0.13
231	000825	太钢不锈	65,311	464,361.21	0.13
232	002038	双鹭药业	8,073	457,335.45	0.13
233	601021	春秋航空	3,611	455,310.99	0.13
234	000400	许继电气	17,815	448,225.40	0.13
235	601216	内蒙君正	18,488	445,006.16	0.13
236	000831	五矿稀土	17,322	443,096.76	0.13
237	000983	西山煤电	46,411	439,976.28	0.12
238	600316	洪都航空	12,669	438,094.02	0.12
239	600166	福田汽车	49,093	433,491.19	0.12
240	000027	深圳能源	35,043	432,781.05	0.12
241	600038	中直股份	6,959	431,110.05	0.12
242	000729	燕京啤酒	41,376	430,310.40	0.12
243	600497	驰宏锌锗	29,447	429,631.73	0.12

244	603000	人民网	8,141	424,390.33	0.12
245	600277	亿利能源	28,250	413,015.00	0.12
246	000960	锡业股份	20,336	409,770.40	0.12
247	600008	首创股份	28,395	407,468.25	0.12
248	600597	光明乳业	17,648	405,904.00	0.11
249	002470	金正大	18,390	399,246.90	0.11
250	601929	吉视传媒	25,931	392,076.72	0.11
251	600373	中文传媒	16,238	389,062.48	0.11
252	000898	鞍钢股份	52,871	385,958.30	0.11
253	601928	凤凰传媒	22,483	384,459.30	0.11
254	002007	华兰生物	8,562	379,210.98	0.11
255	601992	金隅股份	31,084	371,453.80	0.10
256	600717	天津港	24,655	369,578.45	0.10
257	600578	京能电力	40,790	364,254.70	0.10
258	300015	爱尔眼科	11,261	363,279.86	0.10
259	600348	阳泉煤业	35,405	362,901.25	0.10
260	600516	方大炭素	30,391	361,956.81	0.10
261	600317	营口港	57,173	360,189.90	0.10
262	000999	华润三九	11,534	350,518.26	0.10
263	600633	浙报传媒	17,491	342,823.60	0.10
264	601699	潞安环能	35,234	340,712.78	0.10
265	601118	海南橡胶	34,696	339,326.88	0.10
266	002051	中工国际	11,388	339,134.64	0.10
267	300146	汤臣倍健	8,568	336,551.04	0.09
268	601958	金钼股份	28,523	336,000.94	0.09
269	600783	鲁信创投	8,757	328,212.36	0.09
270	002344	海宁皮城	16,487	323,639.81	0.09
271	300251	光线传媒	12,960	322,704.00	0.09
272	600549	厦门钨业	12,737	321,736.62	0.09
273	300133	华策影视	11,534	311,418.00	0.09
274	002570	贝因美	15,046	292,042.86	0.08
275	600648	外高桥	8,255	289,585.40	0.08
276	002001	新和成	16,383	279,985.47	0.08
277	002294	信立泰	9,243	264,349.80	0.07
278	000937	冀中能源	31,215	250,344.30	0.07
279	603288	海天味业	7,761	247,886.34	0.07
280	002399	海普瑞	7,069	240,275.31	0.07
281	600998	九州通	9,679	216,422.44	0.06
282	600809	山西汾酒	7,449	210,359.76	0.06

283	600485	信威集团	4,307	189,034.23	0.05
284	601158	重庆水务	16,961	182,161.14	0.05
285	002653	海思科	6,345	171,315.00	0.05
286	600188	兖州煤业	11,336	155,870.00	0.04
287	000156	华数传媒	3,801	135,999.78	0.04
288	601969	海南矿业	6,020	109,744.60	0.03
289	603993	洛阳钼业	8,824	109,064.64	0.03
290	601231	环旭电子	6,407	108,983.07	0.03

### 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	600395	盘江股份	20,312	319,101.52	0.09
2	600872	中炬高新	9,030	209,225.10	0.06
3	600058	五矿发展	6,084	198,764.28	0.06
4	002416	爱施德	8,178	169,039.26	0.05
5	000996	中国中期	4,500	128,700.00	0.04
6	002116	中国海诚	5,460	104,886.60	0.03
7	300294	博雅生物	1,300	102,479.00	0.03
8	002552	宝鼎重工	4,854	99,507.00	0.03
9	002203	海亮股份	5,000	63,550.00	0.02
10	600209	罗顿发展	2,800	36,624.00	0.01
11	002114	罗平锌电	794	15,768.84	0.00
12	000786	北新建材	400	7,432.00	0.00

## 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	601318	中国平安	12,827,074.02	2.83
2	600016	民生银行	9,808,096.00	2.16
3	601766	中国中车	8,601,379.58	1.90
4	600030	中信证券	6,842,260.00	1.51

5	600000	浦发银行	6,709,399.23	1.48
6	600837	海通证券	6,477,607.77	1.43
7	600036	招商银行	6,231,303.00	1.37
8	601166	兴业银行	6,165,197.00	1.36
9	601988	中国银行	6,017,260.00	1.33
10	601628	中国人寿	4,682,038.23	1.03
11	000166	申万宏源	4,501,970.32	0.99
12	000002	万科A	4,473,459.81	0.99
13	601398	工商银行	4,464,092.00	0.98
14	601328	交通银行	4,368,165.72	0.96
15	601169	北京银行	3,522,338.33	0.78
16	000651	格力电器	3,489,971.65	0.77
17	601668	中国建筑	3,239,735.00	0.71
18	601377	兴业证券	3,163,614.00	0.70
19	601688	华泰证券	3,088,014.00	0.68
20	600637	东方明珠	3,035,415.32	0.67

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	601318	中国平安	22,335,235.52	4.92
2	600016	民生银行	16,713,474.59	3.68
3	600036	招商银行	14,456,639.58	3.19
4	600030	中信证券	14,044,389.28	3.10
5	601166	兴业银行	11,937,707.03	2.63
6	600837	海通证券	11,915,744.88	2.63
7	600000	浦发银行	11,891,343.46	2.62
8	000002	万科A	7,533,862.85	1.66
9	601398	工商银行	7,381,110.51	1.63
10	601328	交通银行	6,741,822.80	1.49
11	601668	中国建筑	6,510,585.40	1.44
12	000651	格力电器	6,268,588.90	1.38
13	601601	中国太保	6,066,179.77	1.34
14	601628	中国人寿	6,014,330.86	1.33
15	000001	平安银行	5,859,796.53	1.29

16	601766	中国中车	5,731,437.73	1.26
17	600887	伊利股份	5,534,838.75	1.22
18	601818	光大银行	5,459,418.21	1.20
19	600519	贵州茅台	5,420,249.75	1.19
20	601288	农业银行	5,272,550.32	1.16

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	370,044,195.31
卖出股票收入（成交）总额	599,713,408.96

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	354,510.09
2	应收证券清算款	6,262,078.97
3	应收股利	-
4	应收利息	5,289.18
5	应收申购款	709,846.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,331,724.65

### 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

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。

#### 7.12.5.2 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	600395	盘江股份	319,101.52	0.09	重大事项
2	600872	中炬高新	209,225.10	0.06	重大事项
3	002416	爱施德	169,039.26	0.05	重大事项
4	000996	中国中期	128,700.00	0.04	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，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 300A	507	170,565.92	74,576,291.00	86.24%	11,900,629.00	13.76%
银华 300B	2,097	41,238.40	16,435,293.00	19.01%	70,041,627.00	80.99%
300 分级	6,365	19,397.83	4,613,543.71	3.74%	118,853,627.76	96.26%
合计	8,969	33,049.51	95,625,127.71	32.26%	200,795,883.76	67.74%

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 300A

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	33,720,374.00	38.99%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	20,267,769.00	23.44%
3	国泰君安证券股份有限公司	5,845,342.00	6.76%
4	海通资管—上海银行—海通赢家系列—月月赢集合资产管理计划	4,081,100.00	4.72%
5	华能贵诚信托有限公司	3,432,891.00	3.97%
6	海通资管—民生—海通年年升集合资产管理计划	3,000,000.00	3.47%
7	中意人寿保险有限公司—投连产品—股票账户	1,704,199.00	1.97%
8	彭漫波	1,500,000.00	1.73%
9	方正证券股份有限公司	1,495,801.00	1.73%
10	广发证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,277,154.00	1.48%

## 银华 300B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理计划	8,753,000.00	10.12%
2	国泰君安证券股份有限公司	4,723,400.00	5.46%
3	刘熹	3,847,380.00	4.45%
4	方正证券股份有限公司	1,821,793.00	2.11%
5	王雪青	1,769,139.00	2.05%
6	招商证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,185,300.00	1.37%
7	招商基金—工商银行—前海人寿保险股份有限公司	1,121,400.00	1.30%
8	覃贵良	1,070,600.00	1.24%
9	梁华龙	1,004,956.00	1.16%
10	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	934,904.00	1.08%

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	银华 300A	-	-
	银华 300B	-	-
	300 分级	8,499.78	0.01%
	合计	8,499.78	0.00%

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	银华 300A	0
	银华 300B	0
	300 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华 300A	0
	银华 300B	0
	300 分级	0

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华 300A	银华 300B	300 分级
基金合同生效日（2014 年 1 月 7 日）	8,326,722.00	8,326,722.00	233,287,779.01
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	54,314,079.00	54,314,079.00	201,435,178.90
本报告期基金总申购份额	-	-	402,007,371.30
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	567,095,348.02
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	32,162,841.00	32,162,841.00	87,119,969.29
本报告期末基金份额总额	86,476,920.00	86,476,920.00	123,467,171.47

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份额折算后的调整份额。

## § 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

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

### 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	
长江证券股份有限公司	2	195,914,889.35	20.67%	178,364.18	20.67%	-
中信证券股份有限公司	3	120,226,254.04	12.68%	109,457.88	12.69%	-
湘财证券有限责任公司	1	73,630,320.13	7.77%	67,033.19	7.77%	-
西南证券股份有限公司	1	68,199,949.88	7.20%	62,090.27	7.20%	-
光大证券股份有限公司	3	53,468,316.87	5.64%	48,675.93	5.64%	-
招商证券股份有限公司	2	49,971,776.33	5.27%	45,495.01	5.27%	-
华创证券股份有限公司	2	48,322,212.78	5.10%	43,991.90	5.10%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	48,003,226.06	5.06%	43,706.14	5.07%	-
东方证券股份有限公司	2	46,741,478.00	4.93%	42,553.40	4.93%	-
渤海证券股份有限公司	1	38,399,138.87	4.05%	34,958.60	4.05%	-
安信证券股份有限公司	3	33,830,148.79	3.57%	30,804.73	3.57%	-

有限公司						
兴业证券股份 有限公司	3	26,002,011.51	2.74%	23,671.85	2.74%	-
第一创业证券 有限责任公司	2	24,134,125.03	2.55%	21,977.07	2.55%	-
广州证券有限 责任公司	1	24,117,411.35	2.54%	21,958.78	2.54%	-
中国中投证券 有限责任公司	1	22,528,626.35	2.38%	20,508.93	2.38%	-
华泰证券股份 有限公司	3	15,105,373.81	1.59%	13,751.65	1.59%	-
申银宏源集团 股份有限公司	2	13,695,071.44	1.44%	12,468.31	1.44%	-
广发证券股份 有限公司	2	13,694,106.29	1.44%	12,465.38	1.44%	-
中国银河证券 股份有限公司	1	12,399,367.28	1.31%	11,288.31	1.31%	-
国信证券股份 有限公司	3	6,755,303.00	0.71%	6,148.07	0.71%	-
国金证券股份 有限公司	2	6,684,852.68	0.71%	6,085.80	0.71%	-
华宝证券有限 责任公司	1	3,416,359.00	0.36%	3,110.32	0.36%	-
齐鲁证券有限 公司	1	1,460,052.09	0.15%	1,329.10	0.15%	-
海通证券股份 有限公司	2	1,088,528.18	0.11%	991.01	0.11%	-
西部证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
江海证券有限 公司	2	-	-	-	-	-
民生证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司						
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中原证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
首创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
日信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	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。

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	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	《银华基金管理有限公司 2014 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	2015 年 1 月 5 日
3	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回及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	2015 年 1 月 6 日
4	《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
5	《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间银华 300A 份额、银华 300B 份额停复牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 7 日
6	《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金不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	2015 年 1 月 8 日
7	《关于银华 300A、银华 300B 份额不定期份额折算后前收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 8 日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开通定投业务并参加“倾心回馈”基金定投优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 16 日
9	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 20 日
10	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的天龙集团估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 27 日

11	《银华基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 29 日
12	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的新华保险估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 3 日
13	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华侨城 A 估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 9 日
14	《银华基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
15	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 17 日
16	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 17 日
17	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大北农估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 5 日
18	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 6 日
19	《关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 10 日
20	《关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 13 日
21	《关于旗下部分基金持有的长安汽车、高新兴、中天科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
22	《关于旗下部分基金持有的探路者、海航投资、吉林森工估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的涪陵榨菜、中国国旅、众业达估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 23 日
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的光明乳业、盛运股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
25	《银华基金管理有限公司关于增加太平洋证券为旗下部分基金代	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 25 日



	销机构的公告》		
26	《银华基金管理有限公司关于增加中金公司为旗下部分基金代销及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
27	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 28 日
28	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 28 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的阳光电源、美克家居、铜陵有色、安泰科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 3 日
30	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的复星医药估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 8 日
31	《银华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行作为旗下部分基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 9 日
32	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的招商银行、银座股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 13 日
33	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中环股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 18 日
34	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 22 日
35	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东方航空、久联发展、模塑科技、博晖创新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 24 日
36	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东华软件估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 25 日
37	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的紫金矿业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
38	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
39	《银华基金管理有限公司关于旗下部分指数型证券投资基金变更场内简称的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日

40	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的招商地产估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
41	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中国北车、中国南车、方大炭素、华润万东估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 21 日
42	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金螳螂、正泰电器、亿帆鑫富、国睿科技、多氟多、深科技、高德红外、长信科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 23 日
43	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金浦钛业、奥飞动漫、中炬高新、航天电子、中源协和、奥瑞金估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
44	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的博雅生物估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
45	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的三安光电、腾邦国际估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 30 日
46	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 2 日
47	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 9 日
48	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的广汇能源估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
49	《银华基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下部分基金代销及转换业务》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
50	《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	2015 年 6 月 10 日
51	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华闻传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 12 日
52	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的京天利、暴风科技、中国重工估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 18 日

53	《关于旗下部分基金持有的常山药业、国金证券、金亚科技、云南铜业、大立科技、信质电机估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
54	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 26 日
55	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的茂业物流、电广传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 27 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 中国证监会核准银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）募集的文件
- 12.1.2 《银华沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 12.1.6 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 12.1.7 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 12.1.8 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.9 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.10 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.11 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 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  
2015 年 8 月 26 日