

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资
基金
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 25 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 2017 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	银华基金管理股份有限公司		
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	56,235,824.20 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 年 12 月 11 日		
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	2,642,395.00 份	2,642,395.00 份	50,951,034.20 份

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	<p>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。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 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。</p> <p>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</p>

	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		银华基金管理股份有限公司	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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-5,720,716.35
本期利润	-1,937,139.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0395
本期加权平均净值利润率	-4.07%
本期基金份额净值增长率	-4.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,251,475.41
期末可供分配基金份额利润	0.0223
期末基金资产净值	53,285,718.45
期末基金份额净值	0.948
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	41.13%

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、本报告所列表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	5.22%	0.80%	4.55%	0.75%	0.67%	0.05%
过去三个月	-5.29%	0.94%	-2.54%	0.85%	-2.75%	0.09%
过去六个月	-4.53%	0.85%	-0.38%	0.75%	-4.15%	0.10%
过去一年	-2.05%	0.83%	3.32%	0.80%	-5.37%	0.03%
过去三年	43.87%	1.83%	63.45%	1.87%	-19.58%	-0.04%
自基金合同生效起至今	41.13%	1.72%	63.58%	1.76%	-22.45%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。
如本基金标的指数变化，则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：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。

§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。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 79 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、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(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、银华消费主题分级混合型证券投资基金、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、银华中小盘精选混合型证券投资基金、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)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、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、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、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金。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	-	17 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。 2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，自 2010 年 5 月 7 日起担任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，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。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	-	7 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 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日起兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 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，本基金管理人所有投资组合不存在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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽管报告期内本基金多次发生大额申购赎回，我们仍将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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.948 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.53%，业绩比较基准收益率为-0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年二季度 A 股市场震荡上行，小幅上涨。 二季度沪深 300 指数上涨 6.10%，深证 100 指数小幅上涨 7.68%。二季度市场在窄幅震荡中小幅上行，从大小盘风格来看，大盘股票强于小盘股，深 100 指数涨幅好于沪深 300，行业方面，17 年以来表现最强的是以家电、食品饮料为主的消费和建材为首的周期行业。

展望三季度，十九大召开在即，开会年求稳是总基调，经济与政策在各自的上下轨间运动，保持现状是合理诉求，也是有客观条件支撑。本轮经济复苏由供给侧改革触发补库存开启，叠加全球库存周期共振，使得工业生产恢复，大宗商品价格大涨、全球贸易增速回暖。当前，库存周期进入到全球被动补库阶段，则下半年对应名义 GDP 回落，PPI 回落，全球贸易环比趋弱，此外将同时看到企业利润增速、财政收入增速回落。节奏上，三季度各项指标平缓回落，四季度的向下加速度将加大。从流动性来看，三季度监管对于机构去杠杆的监管和自查力度预计会减弱，有望在四季度终止。从行业配置来看，2015 年起消费对 GDP 贡献率超过固定资本形成，下半年全球库存周期回落中消费的稳定可能是经济的主要支撑力。由于监管方向变化带来的市场竞争格局变化，龙头股策略将是价值投资的主线，如周期消费成长的龙头股，如新零售龙头、油气等依然值得配置；由于人口的变化，以轻奢品牌为代表的消费升级时代到来，消费升级主线的战略，如家电家具家居旅游休闲，苹果产业链、传媒、人工智能服务、基因治疗、教育等行业；自下而上选择增速与价格匹配的个股，白酒和医药龙头股；另外银行业估值依旧较低，另有高分红，依然是各大基金青睐的板块品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定

价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，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 2017 年 1 月 10 日至 2017 年 2 月 20 日和 2017 年 3 月 28 日至 2017 年 6 月 22 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	3,702,216.24	4,249,719.03
结算备付金	402,198.74	1,680.59
存出保证金	5,374.10	5,921.39
交易性金融资产	49,472,031.26	45,869,041.49
其中：股票投资	49,472,031.26	45,869,041.49
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,684.58	847.62
应收股利	-	-
应收申购款	49,915.88	13,004.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,633,420.80	50,140,214.52
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	153,953.67
应付赎回款	1,140.79	451,968.29
应付管理人报酬	37,562.45	42,658.30
应付托管费	7,512.49	8,531.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,648.34	50,613.20

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	295,838.28	196,677.30
负债合计	347,702.35	904,402.44
所有者权益：		
实收基金	37,776,315.17	33,305,188.79
未分配利润	15,509,403.28	15,930,623.29
所有者权益合计	53,285,718.45	49,235,812.08
负债和所有者权益总计	53,633,420.80	50,140,214.52

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，800 分级份额净值为人民币 0.948 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.029 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.867 元；基金份额总额为 56,235,824.20 份，其中 800 分级份额为 50,951,034.20 份，中证 800A 份额为 2,642,395.00 份，中证 800B 份额为 2,642,395.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-1,076,945.46	-9,209,371.57
1.利息收入	15,539.39	21,595.89
其中：存款利息收入	15,539.39	21,401.88
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	-	194.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,880,575.72	-5,912,861.65
其中：股票投资收益	-5,236,644.82	-6,373,766.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	159,400.00
股利收益	356,069.10	301,504.98

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,783,576.68	-3,360,195.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,514.19	42,089.79
减：二、费用	860,194.21	719,625.97
1. 管理人报酬	235,725.73	268,404.77
2. 托管费	47,145.14	53,680.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	265,423.21	84,560.43
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	311,900.13	312,979.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,937,139.67	-9,928,997.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,937,139.67	-9,928,997.54

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	33,305,188.79	15,930,623.29	49,235,812.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,937,139.67	-1,937,139.67
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）	4,471,126.38	1,515,919.66	5,987,046.04
其中：1.基金申购款	7,407,372.61	2,874,035.83	10,281,408.44
2.基金赎回款	-2,936,246.23	-1,358,116.17	-4,294,362.40
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）	37,776,315.17	15,509,403.28	53,285,718.45
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	32,512,781.88	23,670,142.38	56,182,924.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,928,997.54	-9,928,997.54
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）	107,871.13	619,762.72	727,633.85
其中：1.基金申购款	24,245,760.59	10,283,239.08	34,528,999.67
2.基金赎回款	-24,137,889.46	-9,663,476.36	-33,801,365.82
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）	32,620,653.01	14,360,907.56	46,981,560.57

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	_____ 凌宇翔	_____ 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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 营业税、增值税

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补

充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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 号文《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；

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、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利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
银华基金管理股份有限公司	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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	235,725.73	268,404.77
其中：支付销售机构的客户维护费	35,887.75	48,693.72

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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

6.4.5.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,145.14	53,680.93

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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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及上年度末均未持有本基金份额。

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	3,702,216.24	12,328.24	4,191,866.93	19,637.05

6.4.5.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中银国际证券	601099	太平洋	配股	2,160	9,158.40

注：本基金本报告期末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

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（2017 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
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	47,550	488,988.00	491,191.50	-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事项	3.50	-	-	129,500	453,250.00	453,250.00	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	51,300	468,369.00	446,310.00	-
600657	信达	2017	重大	5.76	2017	6.19	71,507	443,400.18	411,880.32	-

	地产业	2017年2月20日	事项		2017年8月10日					
300271	华宇软件	2017年6月22日	重大事项	16.59	2017年7月4日	16.80	4,300	71,066.00	71,337.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项	24.95	2017年7月4日	22.46	2,769	64,782.95	69,086.55	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项	15.75	2017年8月9日	14.50	3,969	54,250.67	62,511.75	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	10.22		-	5,758	81,537.83	58,846.76	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事项	6.56		-	8,684	57,439.53	56,967.04	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50		-	4,123	84,995.70	51,537.50	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.32		-	3,471	41,709.59	39,291.72	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	14.59		-	2,347	55,759.18	34,242.73	-
600654	*ST中安	2017年6月7日	重大事项	13.48		-	2,000	34,950.00	26,960.00	-

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	49,472,031.26	92.24
	其中：股票	49,472,031.26	92.24
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	4,104,414.98	7.65
7	其他各项资产	56,974.56	0.11
8	合计	53,633,420.80	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境内股票投资组合

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	453,250.00	0.85
B	采矿业	1,339,236.00	2.51
C	制造业	22,607,960.10	42.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,534,110.00	4.76
E	建筑业	2,326,735.00	4.37
F	批发和零售业	3,688,065.63	6.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,478,172.00	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	881,057.40	1.65
J	金融业	3,286,618.00	6.17
K	房地产业	4,684,008.32	8.79
L	租赁和商务服务业	199,881.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	242,144.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	213,928.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,271,732.00	2.39
S	综合	-	-
	合计	45,206,897.45	84.84

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	51,537.50	0.10
C	制造业	2,802,629.31	5.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	483,336.00	0.91
F	批发和零售业	256,564.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	440,680.00	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	230,387.00	0.43
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	-	-
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	4,265,133.81	8.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600219	南山铝业	635,500	2,154,345.00	4.04
2	600039	四川路桥	334,300	1,390,688.00	2.61
3	000517	荣安地产	280,000	1,302,000.00	2.44
4	600743	华远地产	294,800	1,244,056.00	2.33
5	000761	本钢板材	220,000	1,150,600.00	2.16
6	601000	唐山港	217,400	1,134,828.00	2.13
7	600642	申能股份	176,600	1,112,580.00	2.09
8	000543	皖能电力	163,000	950,290.00	1.78
9	600348	阳泉煤业	131,700	892,926.00	1.68
10	000830	鲁西化工	129,000	890,100.00	1.67

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	600133	东湖高新	50,400	483,336.00	0.91
2	300064	豫金刚石	44,100	458,640.00	0.86
3	000900	现代投资	47,900	440,680.00	0.83
4	002203	海亮股份	53,700	437,118.00	0.82
5	601636	旗滨集团	90,600	408,606.00	0.77

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	600219	南山铝业	2,086,289.00	4.24
2	002491	通鼎互联	1,872,323.39	3.80
3	600743	华远地产	1,864,348.10	3.79
4	300287	飞利信	1,843,267.86	3.74
5	000400	许继电气	1,736,788.22	3.53
6	601000	唐山港	1,634,733.00	3.32
7	600823	世茂股份	1,621,560.00	3.29
8	000761	本钢板材	1,560,277.88	3.17
9	300253	卫宁健康	1,543,933.33	3.14
10	600628	新世界	1,512,693.00	3.07
11	002416	爱施德	1,481,619.17	3.01
12	600557	康缘药业	1,430,211.20	2.90
13	600757	长江传媒	1,421,252.00	2.89
14	002106	莱宝高科	1,418,313.85	2.88
15	600039	四川路桥	1,396,075.00	2.84
16	000543	皖能电力	1,393,066.00	2.83
17	300026	红日药业	1,354,715.00	2.75
18	002078	太阳纸业	1,354,706.54	2.75
19	002477	雏鹰农牧	1,348,534.08	2.74
20	600141	兴发集团	1,344,035.00	2.73
21	601231	环旭电子	1,321,032.88	2.68
22	000517	荣安地产	1,315,244.56	2.67
23	000547	航天发展	1,312,170.91	2.67
24	002498	汉缆股份	1,311,730.00	2.66
25	300274	阳光电源	1,295,827.83	2.63
26	600801	华新水泥	1,294,665.00	2.63
27	600835	上海机电	1,290,422.00	2.62
28	300166	东方国信	1,267,578.40	2.57
29	600325	华发股份	1,252,387.00	2.54
30	002727	一心堂	1,199,024.80	2.44
31	600067	冠城大通	1,194,882.96	2.43
32	600694	大商股份	1,180,021.72	2.40
33	600981	汇鸿集团	1,176,480.32	2.39
34	002238	天威视讯	1,171,187.28	2.38

35	600499	科达洁能	1,168,628.84	2.37
36	600790	轻纺城	1,160,193.08	2.36
37	002285	世联行	1,132,980.47	2.30
38	600874	创业环保	1,130,935.00	2.30
39	600597	光明乳业	1,126,544.44	2.29
40	002242	九阳股份	1,122,773.00	2.28
41	600862	中航高科	1,121,126.00	2.28
42	600611	大众交通	1,116,602.00	2.27
43	300010	立思辰	1,112,129.47	2.26
44	600642	申能股份	1,104,104.00	2.24
45	000528	柳 工	1,078,726.00	2.19
46	600284	浦东建设	1,073,278.65	2.18
47	000685	中山公用	1,069,910.95	2.17
48	601678	滨化股份	1,068,704.33	2.17
49	000541	佛山照明	1,050,763.28	2.13
50	600073	上海梅林	1,026,759.00	2.09
51	600483	福能股份	995,094.56	2.02
52	000960	锡业股份	988,560.52	2.01
53	600422	昆药集团	988,480.00	2.01
54	300202	聚龙股份	986,349.00	2.00

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	002491	通鼎互联	1,996,339.11	4.05
2	300287	飞利信	1,798,129.00	3.65
3	000400	许继电气	1,791,578.54	3.64
4	600823	世茂股份	1,758,589.60	3.57
5	600557	康缘药业	1,639,085.12	3.33
6	300253	卫宁健康	1,576,079.40	3.20
7	300026	红日药业	1,553,007.00	3.15
8	300274	阳光电源	1,494,892.60	3.04
9	002106	莱宝高科	1,487,776.48	3.02
10	002498	汉缆股份	1,435,096.00	2.91

11	000547	航天发展	1,390,768.28	2.82
12	002477	雏鹰农牧	1,387,684.67	2.82
13	600981	汇鸿集团	1,386,305.67	2.82
14	600862	中航高科	1,340,163.00	2.72
15	600067	冠城大通	1,330,173.81	2.70
16	600874	创业环保	1,318,575.42	2.68
17	002727	一心堂	1,282,651.60	2.61
18	002238	天威视讯	1,281,583.46	2.60
19	600790	轻纺城	1,280,379.24	2.60
20	601231	环旭电子	1,256,973.90	2.55
21	600694	大商股份	1,239,209.80	2.52
22	600483	福能股份	1,211,540.31	2.46
23	002242	九阳股份	1,201,077.16	2.44
24	600499	科达洁能	1,194,346.52	2.43
25	603567	珍宝岛	1,177,031.51	2.39
26	300010	立思辰	1,173,302.26	2.38
27	002001	新 和 成	1,159,847.71	2.36
28	000685	中山公用	1,152,614.16	2.34
29	002317	众生药业	1,109,751.04	2.25
30	600835	上海机电	1,076,269.48	2.19
31	300202	聚龙股份	1,073,996.92	2.18
32	000620	新华联	1,073,961.10	2.18
33	600628	新世界	1,046,991.91	2.13
34	600748	上实发展	1,027,942.15	2.09
35	600422	昆药集团	1,025,726.71	2.08

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	218,691,008.96
卖出股票收入（成交）总额	213,634,951.05

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	5,374.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,684.58
5	应收申购款	49,915.88

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,974.56

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未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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

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

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
中证 800A	114	23,178.90	1,097,318.00	41.53%	1,545,077.00	58.47%
中证 800B	602	4,389.36	22.00	0.00%	2,642,373.00	100.00%
800 分级	1,592	32,004.42	30,836,091.46	60.52%	20,114,942.74	39.48%
合计	2,308	24,365.61	31,933,431.46	56.78%	24,302,392.74	43.22%

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	太平资管—建设银行—太平资产乾坤 10 号资管产品	920,053.00	34.48%
2	李怡名	564,841.00	21.17%
3	郑志坤	293,972.00	11.02%
4	王平	253,700.00	9.51%
5	未来泽时（上海）资产管理中心（有限合伙）—华夏未来添时三号私募证券投资基金	90,000.00	3.37%
6	张维琴	59,400.00	2.23%
7	胡葛芳	57,451.00	2.15%
8	上海明沘投资管理有限公司—明沘 CTA 一号基金	50,000.00	1.87%
9	陶玲	25,770.00	0.97%
10	孙明芳	21,300.00	0.80%

中证 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	赵红军	248,170.00	9.30%
2	田建明	178,901.00	6.70%

3	杨成英	140,000.00	5.25%
4	李明华	102,017.00	3.82%
5	何凤珍	99,695.00	3.74%
6	王玉印	94,940.00	3.56%
7	查刚	60,500.00	2.27%
8	屈晓东	59,977.00	2.25%
9	李芳华	57,400.00	2.15%
10	王亚峰	56,801.00	2.13%

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	228,834.86	0.45%
	合计	228,834.86	0.41%

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	2,932,616.00	2,932,616.00	43,714,649.12
本报告期基金总申购份额	-	-	11,027,301.54
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	4,371,358.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-290,221.00	-290,221.00	580,442.00
本报告期末基金份额总额	2,642,395.00	2,642,395.00	50,951,034.20

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
方正证券股 份有限公司	4	432,153,242.93	100.00%	13,523.57	100.00%	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 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	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证	2	-	-	-	-	-

券有限责任公司						
中天证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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

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：本基金本报告期基金租用证券公司交易单元未进行除股票以外的其他证券投资。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/01/01-2017/06/30	22,169,716.93	0.00	0.00	22,169,716.93	39.42%

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回

基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日