

银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63

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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§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	银华基金管理股份有限公司		
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	150,050,404.21 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 年 1 月 21 日		
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	25,996,418.00 份	25,996,418.00 份	98,057,568.21 份

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	<p>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。</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%—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。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。
风险收益特征	本基金为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		银华基金管理股份有限公司	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	yhjj@yhfund.com.cn	tianqingl.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	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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-121,843.79
本期利润	12,936,603.27
加权平均基金份额本期利润	0.0830
本期加权平均净值利润率	9.64%
本期基金份额净值增长率	9.99%
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	4,985,358.50
期末可供分配基金份额利润	0.0332
期末基金资产净值	137,198,752.33
期末基金份额净值	0.914
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	49.03%

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

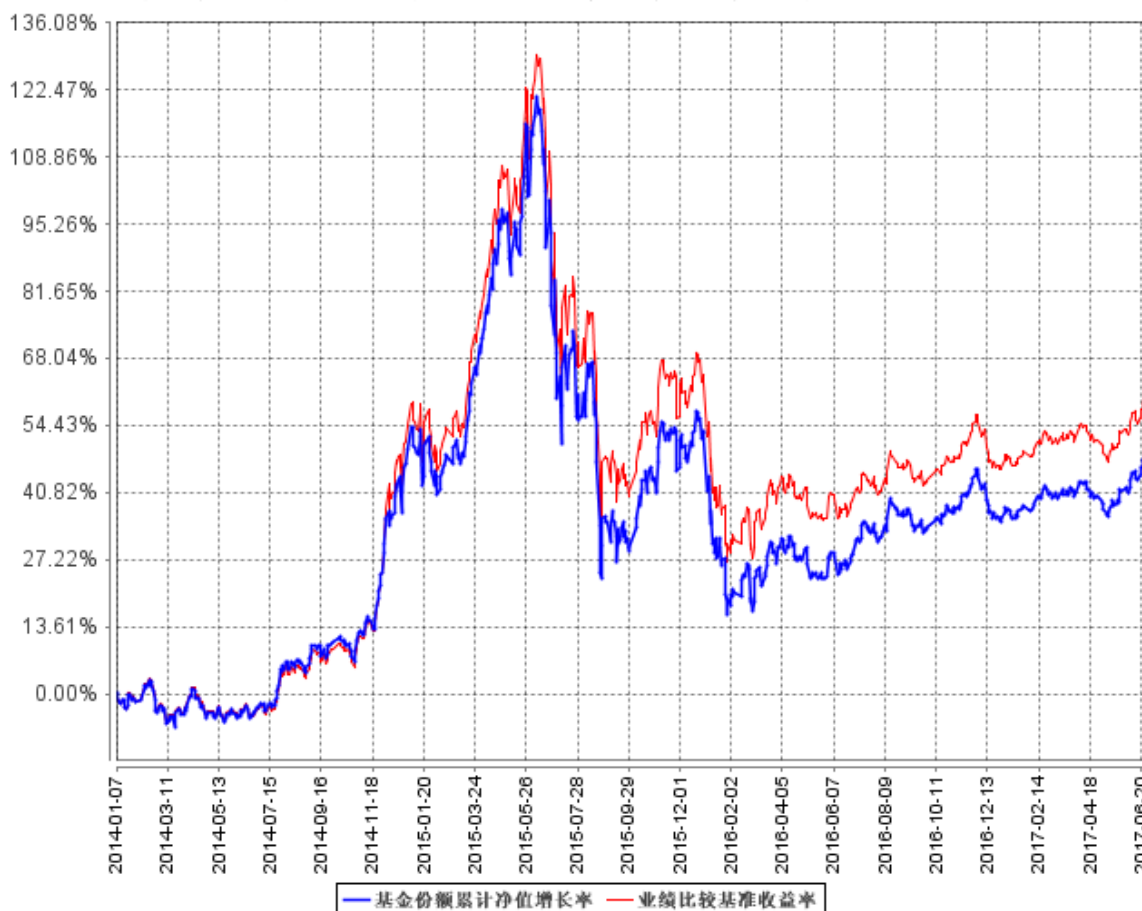
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.18%	0.59%	4.73%	0.64%	0.45%	-0.05%
过去三个月	5.91%	0.56%	5.79%	0.59%	0.12%	-0.03%
过去六个月	9.99%	0.52%	10.23%	0.54%	-0.24%	-0.02%
过去一年	16.14%	0.64%	15.44%	0.63%	0.70%	0.01%
过去三年	53.32%	1.68%	65.95%	1.66%	-12.63%	0.02%
自基金合同生效起至今	49.03%	1.60%	60.83%	1.59%	-11.80%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。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 $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

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。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、银华沪深港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		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2014 年 1 月 7 日	-	8 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 2011 年 9 月 26 日至 2014 年 1 月 6 日兼任银华沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，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 日起至 2016 年 4 月 25 日期间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，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华恒生中国企业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

上半年，股市继续呈现缩量交易、窄幅震荡的态势。金融去杠杆，促使无风险利率一度上行。供给侧改革触发的补库存活动回落。投资者预期紊乱，行情相对平淡。

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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.914 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.99%，业绩比较基准收益率为 10.23%。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 2017 年下半年，我们对市场持相对谨慎的态度。

全球被动补库存活动回落，预计出口增长将会有所回落。房产投资与基建投资受制于去杠杆大环境下货币从紧的影响，难以维持高增速。随着经济增速下滑，居民收入增长预期降低，消费难有意外增长；随着税费制度改革，消费领域内部出现结构性变化。总体来看，经济整体回落是大概率事件，金融监管仍在去杠杆的路上，无风险利率仍将维持高位。但是以上为主动调整的结果，系统性风险可控。我们对下半年市场持相对谨慎的态度。

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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	7,852,986.09	7,814,977.96
结算备付金		-	-
存出保证金		3,912.97	2,071.94
交易性金融资产	6.4.7.2	130,073,688.72	125,334,627.42
其中：股票投资		130,073,688.72	125,334,627.42
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	1,635.40	1,952.28
应收股利		-	-
应收申购款		45,770.46	5,842.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		137,977,993.64	133,159,471.77
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	220,770.52
应付赎回款		318,073.27	34,351.19
应付管理人报酬		110,890.85	116,474.21
应付托管费		24,395.99	25,624.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,210.43	23,913.57

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	300,670.77	199,019.62
负债合计		779,241.31	620,153.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	132,213,393.83	140,561,520.80
未分配利润	6.4.7.10	4,985,358.50	-8,022,202.45
所有者权益合计		137,198,752.33	132,539,318.35
负债和所有者权益总计		137,977,993.64	133,159,471.77

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，300 分级份额净值为人民币 0.914 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 0.799 元；基金份额总额为 150,050,404.21 份，其中 300 分级份额为 98,057,568.21 份，银华 300A 份额为 25,996,418.00 份，银华 300B 份额为 25,996,418.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	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		14,145,735.41	-23,745,623.09
1.利息收入		27,262.95	45,818.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,262.95	45,818.24
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）		1,051,436.30	-2,111,153.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	80,471.19	-3,291,707.59
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	6.4.7.13.5	-	-
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	970,965.11	1,180,554.18

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,058,447.06	-21,702,089.77
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	8,589.10	21,801.85
减：二、费用		1,209,132.14	1,231,325.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	665,328.90	677,177.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	146,372.35	148,979.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	86,549.92	96,435.21
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	310,880.97	308,733.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,936,603.27	-24,976,948.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,936,603.27	-24,976,948.17

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：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）	140,561,520.80	-8,022,202.45	132,539,318.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,936,603.27	12,936,603.27
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）	-8,348,126.97	70,957.68	-8,277,169.29
其中：1.基金申购款	3,483,010.06	-73,212.29	3,409,797.77
2.基金赎回款	-11,831,137.03	144,169.97	-11,686,967.06
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）	132,213,393.83	4,985,358.50	137,198,752.33
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）	152,202,457.11	8,690,509.85	160,892,966.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,976,948.17	-24,976,948.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,548,355.18	-156,152.37	1,392,202.81
其中：1.基金申购款	22,964,256.21	-2,694,152.04	20,270,104.17
2.基金赎回款	-21,415,901.03	2,537,999.67	-18,877,901.36
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）	153,750,812.29	-16,442,590.69	137,308,221.60

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 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股份有限公司，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： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年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

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	7,852,986.09
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,852,986.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	119,698,145.08	130,073,688.72	10,375,543.64
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	119,698,145.08	130,073,688.72	10,375,543.64

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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,548.99
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	84.71
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.70
合计	1,635.40

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	25,210.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,210.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	873.54
其他应付款	3,963.25
预提费用	245,833.98
指数使用费	50,000.00
合计	300,670.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,524,995.40	140,561,520.80
本期申购	3,952,745.57	3,483,010.06
本期赎回(以“-”号填列)	-13,427,336.76	-11,831,137.03
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	150,050,404.21	132,213,393.83

注：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	18,669,798.97	-26,692,001.42	-8,022,202.45
本期利润	-121,843.79	13,058,447.06	12,936,603.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,096,162.17	1,167,119.85	70,957.68
其中：基金申购款	459,357.38	-532,569.67	-73,212.29
基金赎回款	-1,555,519.55	1,699,689.52	144,169.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,451,793.01	-12,466,434.51	4,985,358.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	26,880.52
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	344.60
其他	37.83
合计	27,262.95

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	33,451,858.30
减：卖出股票成本总额	33,371,387.11
买卖股票差价收入	80,471.19

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。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	970,965.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	970,965.11

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	13,058,447.06
——股票投资	13,058,447.06
——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	13,058,447.06

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	8,589.10

合计	8,589.10
----	----------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	86,549.92
银行间市场交易费用	-
合计	86,549.92

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	148,765.71
银行费用	1,046.99
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
上市费	29,752.78
合计	310,880.97

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
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

)	
东北证券股份有限公司 (“东北证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
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

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 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	
	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
东北证券	1,434,616.14	2.49%	-	-
第一创业	6,092,951.42	10.59%	-	-

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 2017年1月1日至2017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
东北证券	1,336.33	2.76%	1,336.33	5.30%
第一创业	5,674.56	11.73%	-	-

注：1、本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

2、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 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	665,328.90	677,177.28
其中：支付销售机构的客户维护费	75,962.88	74,391.40

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 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托管费	146,372.35	148,979.00

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自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自有资金投资银华 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

注：本基金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银华 300A、银华 300B、300 分级份额。

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 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	
	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	7,852,986.09	26,880.52	8,831,001.07	45,151.89

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（2017 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事件	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	110,392	544,808.33	824,628.24	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事件	6.21	-	-	117,088	1,019,774.35	727,116.48	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事件	23.48	-	-	25,877	460,477.15	607,591.96	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事件	3.60	-	-	151,715	563,989.59	546,174.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事件	30.68	-	-	15,755	941,172.31	483,363.40	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事件	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	96,913	376,960.43	332,411.59	-
600100	同方股份	2017 年 4 月	重大事件	14.12	-	-	23,363	309,041.03	329,885.56	-

		21 日	项								
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事 项	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	39,665	442,928.17	300,264.05	-	
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项	14.59	-	-	19,907	546,492.33	290,443.13	-	
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事 项	20.24	-	-	13,070	205,868.15	264,536.80	-	
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事 项	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	49,160	554,697.40	263,006.00	-	
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事 项	24.93	-	-	9,543	259,284.17	237,906.99	-	
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事 项	10.22	-	-	20,514	225,017.58	209,653.08	-	
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事 项	10.57	-	-	19,626	267,152.31	207,446.82	-	
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事 项	7.68	-	-	23,300	213,116.00	178,944.00	-	
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大事 项	17.40	-	-	9,600	184,293.79	167,040.00	-	
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事 项	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	4,700	147,011.30	144,854.00	-	
601872	招商轮船	2017 年 5 月	重大事 项	5.16	-	-	27,857	194,466.81	143,742.12	-	

		2 日	项							
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重 大 事 项	13.48	-	-	10,500	184,021.00	141,540.00	-
601608	中信 重工	2017 年 4 月 19 日	重 大 事 项	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.25	17,201	119,455.89	95,293.54	-
600255	鑫科 材料	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项	4.04	-	-	13,699	62,844.73	55,343.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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 2017 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	7,852,986.09	-	-	-	-	-	7,852,986.09
存出保证金	3,912.97	-	-	-	-	-	3,912.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	130,073,688.72	130,073,688.72
应收利息	-	-	-	-	-	1,635.40	1,635.40
应收申购款	99.40	-	-	-	-	45,671.06	45,770.46

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,856,998.46	-	-	-	-	-130,120,995.18	137,977,993.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	318,073.27	318,073.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,890.85	110,890.85
应付托管费	-	-	-	-	-	24,395.99	24,395.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,210.43	25,210.43
其他负债	-	-	-	-	-	300,670.77	300,670.77
负债总计	-	-	-	-	-	779,241.31	779,241.31
利率敏感度缺口	7,856,998.46	-	-	-	-	-129,341,753.87	137,198,752.33
上年度末 2016 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	7,814,977.96	-	-	-	-	-	7,814,977.96
存出保证金	2,071.94	-	-	-	-	-	2,071.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-125,334,627.42	125,334,627.42
应收利息	-	-	-	-	-	1,952.28	1,952.28
应收申购款	99.40	-	-	-	-	5,742.77	5,842.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,817,149.30	-	-	-	-	-125,342,322.47	133,159,471.77
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	220,770.52	220,770.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,351.19	34,351.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,474.21	116,474.21
应付托管费	-	-	-	-	-	25,624.31	25,624.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,913.57	23,913.57
其他负债	-	-	-	-	-	199,019.62	199,019.62
负债总计	-	-	-	-	-	620,153.42	620,153.42
利率敏感度缺口	7,817,149.30	-	-	-	-	-124,722,169.05	132,539,318.35

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：本基金在报告期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，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资

于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金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。于本报告期末，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	130,073,688.72	94.81	125,334,627.42	94.56
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	130,073,688.72	94.81	125,334,627.42	94.56

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	6,800,819.64	6,719,623.25
	-5%	-6,800,819.64	-6,719,623.25

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	130,073,688.72	94.27
	其中：股票	130,073,688.72	94.27
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	7,852,986.09	5.69
7	其他各项资产	51,318.83	0.04
8	合计	137,977,993.64	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	316,979.64	0.23
B	采矿业	4,219,044.00	3.08
C	制造业	46,534,115.97	33.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,515,746.48	2.56
E	建筑业	5,962,480.71	4.35
F	批发和零售业	2,842,220.96	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,798,270.94	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,830,235.65	4.98
J	金融业	44,020,785.07	32.09
K	房地产业	6,909,078.15	5.04
L	租赁和商务服务业	1,156,498.06	0.84
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,083,084.42	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	260,100.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,518,651.60	1.11
S	综合	385,199.19	0.28
	合计	129,352,490.84	94.28

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	-	-
C	制造业	579,657.88	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	141,540.00	0.10
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	721,197.88	0.53

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	135,084	6,701,517.24	4.88
2	600519	贵州茅台	6,368	3,004,740.80	2.19
3	601328	交通银行	418,721	2,579,321.36	1.88
4	601166	兴业银行	152,397	2,569,413.42	1.87
5	000651	格力电器	59,374	2,444,427.58	1.78
6	000333	美的集团	55,889	2,405,462.56	1.75
7	600016	民生银行	288,636	2,372,587.92	1.73
8	000002	万科A	83,634	2,088,340.98	1.52
9	600036	招商银行	86,168	2,060,276.88	1.50
10	601668	中国建筑	183,330	1,774,634.40	1.29
11	600000	浦发银行	137,520	1,739,628.00	1.27
12	600030	中信证券	98,445	1,675,533.90	1.22
13	601288	农业银行	466,699	1,642,780.48	1.20
14	600887	伊利股份	74,585	1,610,290.15	1.17
15	600837	海通证券	101,049	1,500,577.65	1.09
16	601988	中国银行	395,993	1,465,174.10	1.07
17	601398	工商银行	263,626	1,384,036.50	1.01
18	002415	海康威视	42,801	1,382,472.30	1.01
19	601169	北京银行	148,921	1,365,605.57	1.00
20	600104	上汽集团	43,688	1,356,512.40	0.99
21	601601	中国太保	39,913	1,351,853.31	0.99
22	000858	五粮液	23,904	1,330,496.64	0.97
23	601818	光大银行	322,046	1,304,286.30	0.95
24	600900	长江电力	80,962	1,245,195.56	0.91
25	600015	华夏银行	134,695	1,241,887.90	0.91
26	000725	京东方A	290,119	1,206,895.04	0.88
27	601766	中国中车	119,066	1,204,947.92	0.88
28	601211	国泰君安	56,836	1,165,706.36	0.85
29	600276	恒瑞医药	21,307	1,077,921.13	0.79
30	000001	平安银行	105,266	988,447.74	0.72
31	600048	保利地产	87,266	870,042.02	0.63
32	600050	中国联通	110,392	824,628.24	0.60
33	600518	康美药业	37,057	805,619.18	0.59

34	601390	中国中铁	91,274	791,345.58	0.58
35	600028	中国石化	128,640	762,835.20	0.56
36	601688	华泰证券	41,412	741,274.80	0.54
37	600019	宝钢股份	108,376	727,202.96	0.53
38	601989	中国重工	117,088	727,116.48	0.53
39	000063	中兴通讯	29,998	712,152.52	0.52
40	002450	康得新	31,111	700,619.72	0.51
41	601186	中国铁建	56,783	683,099.49	0.50
42	002304	洋河股份	7,647	663,836.07	0.48
43	000776	广发证券	37,743	651,066.75	0.47
44	001979	招商蛇口	29,881	638,258.16	0.47
45	000538	云南白药	6,636	622,788.60	0.45
46	601006	大秦铁路	72,841	611,135.99	0.45
47	601088	中国神华	25,877	607,591.96	0.44
48	600703	三安光电	30,761	605,991.70	0.44
49	601628	中国人寿	21,328	575,429.44	0.42
50	600690	青岛海尔	38,104	573,465.20	0.42
51	600585	海螺水泥	25,172	572,159.56	0.42
52	601336	新华保险	10,776	553,886.40	0.40
53	600958	东方证券	39,549	550,126.59	0.40
54	600795	国电电力	151,715	546,174.00	0.40
55	002024	苏宁云商	46,204	519,795.00	0.38
56	601901	方正证券	52,050	516,856.50	0.38
57	600999	招商证券	29,368	505,716.96	0.37
58	600340	华夏幸福	14,921	501,047.18	0.37
59	600309	万华化学	17,253	494,125.92	0.36
60	002230	科大讯飞	12,294	490,530.60	0.36
61	300104	乐视网	15,755	483,363.40	0.35
62	000423	东阿阿胶	6,697	481,447.33	0.35
63	600741	华域汽车	19,849	481,139.76	0.35
64	600089	特变电工	46,433	479,652.89	0.35
65	600660	福耀玻璃	17,754	462,314.16	0.34
66	601857	中国石油	59,903	460,654.07	0.34
67	600009	上海机场	12,227	456,189.37	0.33
68	601985	中国核电	57,560	449,543.60	0.33
69	000568	泸州老窖	8,881	449,200.98	0.33
70	601669	中国电建	56,590	448,192.80	0.33
71	002241	歌尔股份	23,138	446,100.64	0.33
72	300070	碧水源	23,692	441,855.80	0.32

73	601377	兴业证券	58,944	437,953.92	0.32
74	601899	紫金矿业	127,032	435,719.76	0.32
75	002456	欧菲光	23,892	434,117.64	0.32
76	601607	上海医药	14,644	422,918.72	0.31
77	000166	申万宏源	75,178	420,996.80	0.31
78	300072	三聚环保	11,350	420,517.50	0.31
79	002736	国信证券	31,540	417,905.00	0.30
80	002236	大华股份	18,316	417,787.96	0.30
81	002466	天齐锂业	7,600	413,060.00	0.30
82	000069	华侨城 A	40,881	411,262.86	0.30
83	000338	潍柴动力	30,510	402,732.00	0.29
84	000783	长江证券	41,982	397,569.54	0.29
85	600886	国投电力	50,229	396,809.10	0.29
86	600196	复星医药	12,708	393,820.92	0.29
87	300059	东方财富	32,399	389,435.98	0.28
88	600068	葛洲坝	34,573	388,600.52	0.28
89	600031	三一重工	47,456	385,817.28	0.28
90	600029	南方航空	43,638	379,650.60	0.28
91	601888	中国国旅	12,452	375,303.28	0.27
92	600637	东方明珠	17,308	375,064.36	0.27
93	601788	光大证券	25,100	374,743.00	0.27
94	002008	大族激光	10,790	373,765.60	0.27
95	600066	宇通客车	16,775	368,546.75	0.27
96	600010	包钢股份	167,228	366,229.32	0.27
97	601600	中国铝业	80,734	364,917.68	0.27
98	600606	绿地控股	45,300	354,246.00	0.26
99	000625	长安汽车	24,510	353,434.20	0.26
100	601009	南京银行	31,057	348,148.97	0.25
101	002594	比亚迪	6,950	347,152.50	0.25
102	601555	东吴证券	30,723	345,019.29	0.25
103	000839	中信国安	34,399	343,646.01	0.25
104	601099	太平洋	85,271	342,789.42	0.25
105	600535	天士力	8,203	340,752.62	0.25
106	601933	永辉超市	47,533	336,533.64	0.25
107	600893	航发动力	12,300	335,790.00	0.24
108	000100	TCL 集团	96,913	332,411.59	0.24
109	000413	东旭光电	29,444	330,361.68	0.24
110	600100	同方股份	23,363	329,885.56	0.24
111	601618	中国中冶	65,723	329,272.23	0.24

112	600383	金地集团	28,422	326,000.34	0.24
113	600406	国电南瑞	18,461	325,836.65	0.24
114	600522	中天科技	27,000	325,350.00	0.24
115	000768	中航飞机	17,544	323,511.36	0.24
116	002142	宁波银行	16,757	323,410.10	0.24
117	300124	汇川技术	12,613	322,136.02	0.23
118	002673	西部证券	22,481	319,679.82	0.23
119	600705	中航资本	56,437	318,869.05	0.23
120	600109	国金证券	27,193	318,701.96	0.23
121	600816	安信信托	23,380	317,734.20	0.23
122	002475	立讯精密	10,782	315,265.68	0.23
123	600111	北方稀土	27,491	311,473.03	0.23
124	002202	金风科技	19,838	306,893.86	0.22
125	601800	中国交建	19,268	306,168.52	0.22
126	000963	华东医药	6,144	305,356.80	0.22
127	002739	万达电影	5,971	304,341.87	0.22
128	601727	上海电气	39,665	300,264.05	0.22
129	000895	双汇发展	12,566	298,442.50	0.22
130	600739	辽宁成大	16,213	292,320.39	0.21
131	600570	恒生电子	6,249	291,703.32	0.21
132	600271	航天信息	14,130	291,643.20	0.21
133	600485	信威集团	19,907	290,443.13	0.21
134	000728	国元证券	22,641	276,673.02	0.20
135	601018	宁波港	48,874	276,138.10	0.20
136	600023	浙能电力	50,334	274,823.64	0.20
137	600177	雅戈尔	27,088	274,130.56	0.20
138	600352	浙江龙盛	28,710	273,606.30	0.20
139	600547	山东黄金	9,432	272,867.76	0.20
140	600674	川投能源	27,704	272,053.28	0.20
141	000623	吉林敖东	11,822	270,605.58	0.20
142	300024	机器人	13,848	270,036.00	0.20
143	601992	金隅股份	41,400	267,858.00	0.20
144	601225	陕西煤业	37,582	265,704.74	0.19
145	002252	上海莱士	13,070	264,536.80	0.19
146	601919	中远海控	49,160	263,006.00	0.19
147	002508	老板电器	6,000	260,880.00	0.19
148	002065	东华软件	11,955	260,499.45	0.19
149	002044	美年健康	15,300	260,100.00	0.19
150	600221	海航控股	80,706	259,873.32	0.19

151	002007	华兰生物	7,102	259,223.00	0.19
152	000793	华闻传媒	25,363	256,673.56	0.19
153	600018	上港集团	40,324	255,654.16	0.19
154	600804	鹏博士	14,326	254,286.50	0.19
155	600115	东方航空	36,805	250,274.00	0.18
156	600415	小商品城	34,078	246,724.72	0.18
157	000540	中天金融	35,308	245,390.60	0.18
158	601198	东兴证券	14,192	244,670.08	0.18
159	601111	中国国航	25,062	244,354.50	0.18
160	600085	同仁堂	6,982	244,090.72	0.18
161	000157	中联重科	54,160	243,178.40	0.18
162	603993	洛阳钼业	48,051	243,138.06	0.18
163	600820	隧道股份	23,794	240,319.40	0.18
164	601998	中信银行	38,181	240,158.49	0.18
165	600208	新湖中宝	53,071	238,819.50	0.17
166	000503	海虹控股	9,543	237,906.99	0.17
167	600436	片仔癀	3,800	231,952.00	0.17
168	002465	海格通信	21,562	231,575.88	0.17
169	600153	建发股份	17,887	231,278.91	0.17
170	000826	启迪桑德	6,548	229,965.76	0.17
171	002310	东方园林	13,600	227,392.00	0.17
172	600061	国投安信	14,300	222,365.00	0.16
173	300017	网宿科技	18,274	220,567.18	0.16
174	600362	江西铜业	13,072	220,393.92	0.16
175	002081	金螳螂	20,071	220,379.58	0.16
176	600663	陆家嘴	9,317	220,253.88	0.16
177	000709	河钢股份	52,447	219,752.93	0.16
178	000630	铜陵有色	77,332	219,622.88	0.16
179	000060	中金岭南	19,559	219,060.80	0.16
180	600157	永泰能源	61,305	218,858.85	0.16
181	000009	中国宝安	27,039	218,745.51	0.16
182	000876	新希望	26,496	217,797.12	0.16
183	600489	中金黄金	21,670	217,350.10	0.16
184	300315	掌趣科技	26,507	216,297.12	0.16
185	002146	荣盛发展	21,811	215,274.57	0.16
186	002027	分众传媒	15,400	211,904.00	0.15
187	601155	新城控股	11,400	211,356.00	0.15
188	600170	上海建工	54,856	209,549.92	0.15
189	600332	白云山	7,181	208,536.24	0.15

190	002074	国轩高科	6,600	208,230.00	0.15
191	600118	中国卫星	7,470	207,964.80	0.15
192	002500	山西证券	21,670	207,598.60	0.15
193	600959	江苏有线	19,626	207,446.82	0.15
194	000750	国海证券	37,600	206,800.00	0.15
195	600682	南京新百	5,600	206,640.00	0.15
196	601216	君正集团	41,876	204,773.64	0.15
197	600297	广汇汽车	27,010	203,385.30	0.15
198	601633	长城汽车	15,282	203,097.78	0.15
199	600008	首创股份	30,376	199,874.08	0.15
200	600150	中国船舶	8,706	199,106.22	0.15
201	000425	徐工机械	51,867	194,501.25	0.14
202	300144	宋城演艺	9,203	192,066.61	0.14
203	601333	广深铁路	42,176	190,635.52	0.14
204	000559	万向钱潮	17,437	185,180.94	0.13
205	000792	盐湖股份	17,598	183,899.10	0.13
206	600688	上海石化	27,618	182,554.98	0.13
207	002426	胜利精密	23,300	178,944.00	0.13
208	002195	二三四五	24,782	177,191.30	0.13
209	000402	金融街	15,084	176,784.48	0.13
210	000983	西山煤电	19,899	174,514.23	0.13
211	300033	同花顺	2,800	174,188.00	0.13
212	600583	海油工程	27,837	173,702.88	0.13
213	601117	中国化学	24,800	173,352.00	0.13
214	600718	东软集团	11,027	171,469.85	0.12
215	300027	华谊兄弟	20,984	169,760.56	0.12
216	600649	城投控股	15,988	168,033.88	0.12
217	002411	必康股份	5,800	167,736.00	0.12
218	600498	烽火通信	6,600	167,310.00	0.12
219	600895	张江高科	9,861	166,453.68	0.12
220	600827	百联股份	10,212	165,945.00	0.12
221	600373	中文传媒	6,980	164,099.80	0.12
222	002183	怡亚通	18,800	162,244.00	0.12
223	002385	大北农	25,782	162,168.78	0.12
224	000917	电广传媒	14,329	161,917.70	0.12
225	600256	广汇能源	39,042	161,633.88	0.12
226	000415	渤海金控	23,822	160,322.06	0.12
227	600588	用友网络	9,262	158,565.44	0.12
228	600704	物产中大	21,680	158,047.20	0.12

229	600074	保千里	12,300	157,563.00	0.11
230	000008	神州高铁	21,200	154,336.00	0.11
231	600060	海信电器	9,945	150,865.65	0.11
232	600376	首开股份	13,100	149,864.00	0.11
233	002470	金正大	19,830	149,319.90	0.11
234	601718	际华集团	16,708	146,863.32	0.11
235	002049	紫光国芯	4,700	144,854.00	0.11
236	002558	巨人网络	3,120	144,206.40	0.11
237	601872	招商轮船	27,857	143,742.12	0.10
238	601866	中远海发	39,497	142,189.20	0.10
239	600909	华安证券	13,933	140,583.97	0.10
240	000959	首钢股份	20,000	139,800.00	0.10
241	002174	游族网络	4,400	139,744.00	0.10
242	002352	顺丰控股	2,600	138,216.00	0.10
243	600038	中直股份	3,000	137,310.00	0.10
244	300168	万达信息	9,400	136,770.00	0.10
245	002555	三七互娱	5,300	135,521.00	0.10
246	600977	中国电影	7,066	132,275.52	0.10
247	000977	浪潮信息	7,600	131,632.00	0.10
248	600021	上海电力	10,858	131,273.22	0.10
249	000627	天茂集团	16,200	130,896.00	0.10
250	002152	广电运通	15,450	128,389.50	0.09
251	600037	歌华有线	8,800	128,128.00	0.09
252	600737	中粮糖业	13,000	122,720.00	0.09
253	002714	牧原股份	4,400	119,768.00	0.09
254	000671	阳光城	20,500	119,310.00	0.09
255	600549	厦门钨业	5,500	118,195.00	0.09
256	600372	中航电子	6,740	117,073.80	0.09
257	000938	紫光股份	1,900	116,128.00	0.08
258	002131	利欧股份	35,050	115,314.50	0.08
259	600685	中船防务	4,200	114,996.00	0.08
260	000738	航发控制	5,800	113,506.00	0.08
261	600446	金证股份	6,400	112,512.00	0.08
262	601118	海南橡胶	19,798	112,452.64	0.08
263	000718	苏宁环球	19,100	111,926.00	0.08
264	002292	奥飞娱乐	6,620	111,878.00	0.08
265	600482	中国动力	4,400	111,276.00	0.08
266	000156	华数传媒	7,316	109,081.56	0.08
267	601877	正泰电器	5,400	108,486.00	0.08

268	601375	中原证券	10,251	103,125.06	0.08
269	601021	春秋航空	3,062	102,975.06	0.08
270	002424	贵州百灵	5,400	101,844.00	0.07
271	300133	华策影视	8,873	99,377.60	0.07
272	601881	中国银河	8,261	97,975.46	0.07
273	601608	中信重工	17,201	95,293.54	0.07
274	002153	石基信息	4,108	93,374.84	0.07
275	601997	贵阳银行	5,872	92,836.32	0.07
276	000961	中南建设	14,000	91,280.00	0.07
277	300251	光线传媒	11,108	90,974.52	0.07
278	601958	金钼股份	12,289	88,112.13	0.06
279	002299	圣农发展	5,700	84,759.00	0.06
280	600233	圆通速递	4,300	84,237.00	0.06
281	601611	中国核建	6,591	78,894.27	0.06
282	601163	三角轮胎	2,986	78,531.80	0.06
283	601229	上海银行	2,986	76,262.44	0.06
284	600871	石化油服	22,701	75,821.34	0.06
285	601966	玲珑轮胎	2,986	66,975.98	0.05
286	002602	世纪华通	1,800	65,268.00	0.05
287	603858	步长制药	896	64,189.44	0.05
288	600188	兖州煤业	4,946	60,539.04	0.04
289	000555	神州信息	3,600	60,120.00	0.04
290	603160	汇顶科技	598	59,979.40	0.04
291	600919	江苏银行	5,773	53,631.17	0.04
292	002831	裕同科技	598	44,850.00	0.03
293	002841	视源股份	598	44,383.56	0.03
294	601127	小康股份	2,196	43,810.20	0.03
295	600926	杭州银行	1,792	26,611.20	0.02
296	002839	张家港行	896	14,085.12	0.01

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	002129	中环股份	20,514	209,653.08	0.15
2	600666	奥瑞德	9,600	167,040.00	0.12

3	600654	*ST 中安	10,500	141,540.00	0.10
4	600255	鑫科材料	13,699	55,343.96	0.04
5	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
6	603043	广州酒家	1,773	44,803.71	0.03
7	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
8	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
9	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
10	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01

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	601328	交通银行	1,466,758.00	1.11
2	601988	中国银行	1,426,952.00	1.08
3	600015	华夏银行	1,412,734.00	1.07
4	601166	兴业银行	1,253,468.00	0.95
5	600000	浦发银行	938,272.00	0.71
6	600036	招商银行	585,748.00	0.44
7	601818	光大银行	543,443.00	0.41
8	600893	航发动力	408,851.00	0.31
9	600019	宝钢股份	358,533.04	0.27
10	600522	中天科技	305,959.00	0.23
11	601992	金隅股份	285,017.00	0.22
12	002508	老板电器	262,438.00	0.20
13	002415	海康威视	260,879.00	0.20
14	601318	中国平安	252,494.00	0.19
15	002044	美年健康	244,796.00	0.18
16	600436	片仔癀	213,218.00	0.16
17	600682	南京新百	207,197.00	0.16
18	601117	中国化学	172,059.00	0.13
19	002411	必康股份	163,737.00	0.12
20	002558	巨人网络	143,554.00	0.11

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	601166	兴业银行	1,725,767.96	1.30
2	600036	招商银行	1,568,406.20	1.18
3	601328	交通银行	1,203,955.88	0.91
4	600000	浦发银行	1,103,602.62	0.83
5	601988	中国银行	1,048,611.99	0.79
6	600015	华夏银行	983,407.35	0.74
7	601318	中国平安	820,985.44	0.62
8	601398	工商银行	737,422.55	0.56
9	000783	长江证券	561,602.93	0.42
10	600016	民生银行	412,468.71	0.31
11	601009	南京银行	304,198.75	0.23
12	601668	中国建筑	297,304.43	0.22
13	600867	通化东宝	287,456.22	0.22
14	000002	万科A	284,189.67	0.21
15	600519	贵州茅台	281,898.00	0.21
16	000333	美的集团	281,625.99	0.21
17	000651	格力电器	276,886.61	0.21
18	601288	农业银行	262,432.35	0.20
19	600005	武钢股份	255,503.99	0.19
20	002085	万丰奥威	240,503.00	0.18

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	25,052,001.35
卖出股票收入（成交）总额	33,451,858.30

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	3,912.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,635.40
5	应收申购款	45,770.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,318.83

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	002129	中环股份	209,653.08	0.15	重大事项
2	600666	奥瑞德	167,040.00	0.12	重大事项
3	600654	*ST 中安	141,540.00	0.10	重大事项
4	600255	鑫科材料	55,343.96	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	223	116,575.87	23,237,074.00	89.39%	2,759,344.00	10.61%
银华 300B	887	29,308.25	143,569.00	0.55%	25,852,849.00	99.45%
300 分级	5,341	18,359.40	3,308,722.22	3.37%	94,748,845.99	96.63%
合计	6,451	23,260.02	26,689,365.22	17.79%	123,361,038.99	82.21%

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	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	10,000,000.00	38.47%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募）	7,501,969.00	28.86%
3	工银瑞信基金—农业银行—中油财务有限责任公司	1,840,957.00	7.08%
4	中国对外经济贸易信托有限公司—金得量化套利集合资金信托计划	1,578,809.00	6.07%
5	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	1,278,455.00	4.92%
6	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅一号证券投资基金（私募）	444,953.00	1.71%
7	广发证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	412,553.00	1.59%
8	方春娣	347,300.00	1.34%
9	欧贤茂	343,085.00	1.32%
10	刘幼珍	336,715.00	1.30%

银华 300B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
----	-------	---------	--------

			比例
1	许文广	2,500,000.00	9.62%
2	方玲	2,044,316.00	7.86%
3	花波	1,761,548.00	6.78%
4	李祖平	1,440,891.00	5.54%
5	覃贵良	1,072,500.00	4.13%
6	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,062,100.00	4.09%
7	陈淑芬	628,492.00	2.42%
8	符安民	480,200.00	1.85%
9	黄月梅	372,100.00	1.43%
10	娄湖山	369,300.00	1.42%

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	51,946.55	0.05%
	合计	51,946.55	0.03%

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

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华 300A	银华 300B	300 分级
基金合同生效日（2014 年 1 月 7 日） 基金份额总额	8,326,722.00	8,326,722.00	233,287,779.01
本报告期期初基金份额总额	28,037,868.00	28,037,868.00	103,449,259.40
本报告期基金总申购份额	-	-	3,952,745.57
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	13,427,336.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-2,041,450.00	-2,041,450.00	4,082,900.00
本报告期末基金份额总额	25,996,418.00	25,996,418.00	98,057,568.21

注：拆分变动份额含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	5	12,218,278.16	21.23%	8,935.40	18.47%	-
中国国际金 融有限公司	2	9,484,094.09	16.48%	8,832.80	18.26%	-
东吴证券股 份有限公司	3	7,809,359.32	13.57%	5,709.74	11.80%	-
天风证券股 份有限公司	4	7,128,099.52	12.39%	5,526.31	11.42%	新增 4 个 交易单元
第一创业证 券股份有限 公司	2	6,092,951.42	10.59%	5,674.56	11.73%	-
东方证券股 份有限公司	3	5,638,567.36	9.80%	5,251.23	10.86%	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	4,961,512.81	8.62%	4,620.80	9.55%	-
东北证券股 份有限公司	4	1,434,616.14	2.49%	1,336.33	2.76%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	556,772.54	0.97%	518.73	1.07%	-
华融证券股 份有限公司	1	538,454.33	0.94%	501.62	1.04%	-
华泰证券股 份有限公司	5	529,802.25	0.92%	387.51	0.80%	-
广发证券股 份有限公司	2	343,389.19	0.60%	319.82	0.66%	-
招商证券股 份有限公司	2	330,457.89	0.57%	307.69	0.64%	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	220,447.17	0.38%	205.33	0.42%	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	197,860.08	0.34%	184.26	0.38%	-
长江证券股 份有限公司	2	66,782.00	0.12%	62.20	0.13%	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股	3	-	-	-	-	-

份有限公司						
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	2	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
南京证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
国融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	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：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司 2016 年 12 月 31 日基金净值公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 1 月 21 日
3	《关于旗下部分基金持有的宝钢股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 11 日
4	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 21 日
5	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）》	本基金经理人网站	2017 年 2 月 21 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 23 日
7	《关于旗下部分基金在首创证券开通定期定额投资及转换业务并参加首创证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 27 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 3 月 9 日
9	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告》	本基金经理人网站	2017 年 3 月 31 日
10	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 3 月 31 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 3 月 31 日

	惠活动的公告》		
12	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 21 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 22 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 25 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的商赢环球、山东黄金估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 26 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 26 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 27 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 28 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于实施《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》的风险提示公告.doc》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 4 月 29 日
20	《关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 6 月 22 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的中国神华估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 6 月 29 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于使用建设银行卡网上直销优惠的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 6 月 30 日

§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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

11.2 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 《银华基金管理股份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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日