

# 银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资 基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 28 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 2019 年 3 月 26 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 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.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
8.6 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.....	90
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	90

8.8	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	90
8.9	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	90
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	90
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	90
8.12	投资组合报告附注	91
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>93</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2	期末上市基金前十名持有人	93
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
9.4	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	94
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>95</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>96</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	96
11.2	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	96
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4	基金投资策略的改变	96
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	96
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	96
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
11.8	其他重大事件	104
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>116</b>
12.1	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	116
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	116
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>118</b>
13.1	备查文件目录	118
13.2	存放地点	118
13.3	查阅方式	118

## §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 等权重指数增强分级		
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	43,863,247.77 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	1,920,237.00 份	1,920,237.00 份	40,022,773.77 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，</p>

	<p>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。</p>		
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

注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100738	100818
法定代表人	王珠林	陈四清

## 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》
登载基金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>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通 合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-11,585,591.49	-1,033,612.69	-11,567,715.53
本期利润	-12,799,235.75	1,100,652.49	-8,614,306.13
加权平均基金份额本期利润	-0.2916	0.0215	-0.1622
本期加权平均净值利润率	-34.49%	2.17%	-16.26%
本期基金份额净值增长率	-30.68%	0.71%	-14.49%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-7,300,473.60	5,539,486.14	6,967,192.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1664	0.1064	0.1405
期末基金资产净值	28,619,004.83	50,756,783.13	49,235,812.08
期末基金份额净值	0.652	0.975	0.993
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	3.20%	48.87%	47.83%

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
过去三个月	-13.24%	1.69%	-11.22%	1.67%	-2.02%	0.02%
过去六个月	-18.67%	1.49%	-16.74%	1.44%	-1.93%	0.05%
过去一年	-30.68%	1.40%	-29.91%	1.34%	-0.77%	0.06%
过去三年	-40.30%	1.36%	-39.57%	1.33%	-0.73%	0.03%
过去五年	3.51%	1.61%	14.15%	1.63%	-10.64%	-0.02%

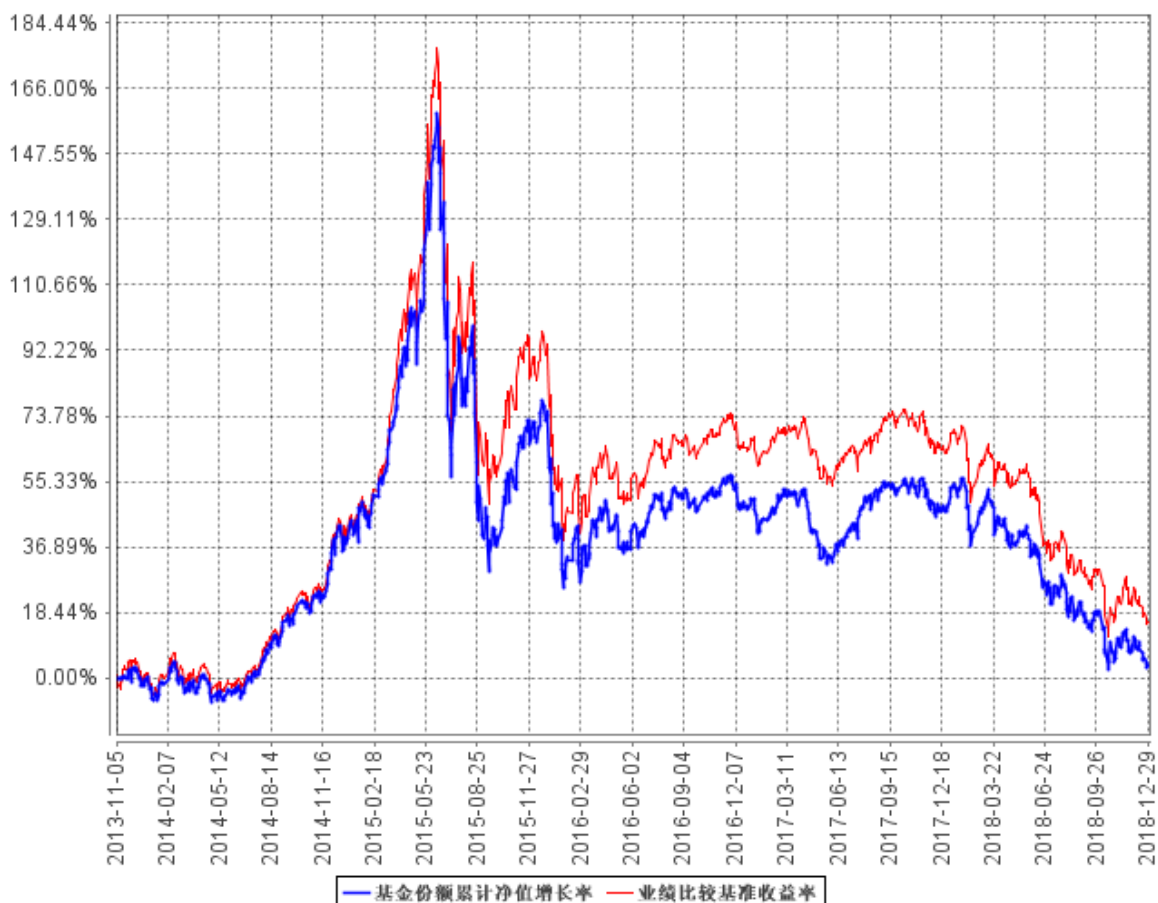


自基金合同生效起至今	3.20%	1.59%	15.63%	1.62%	-12.43%	-0.03%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	--------

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

### 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

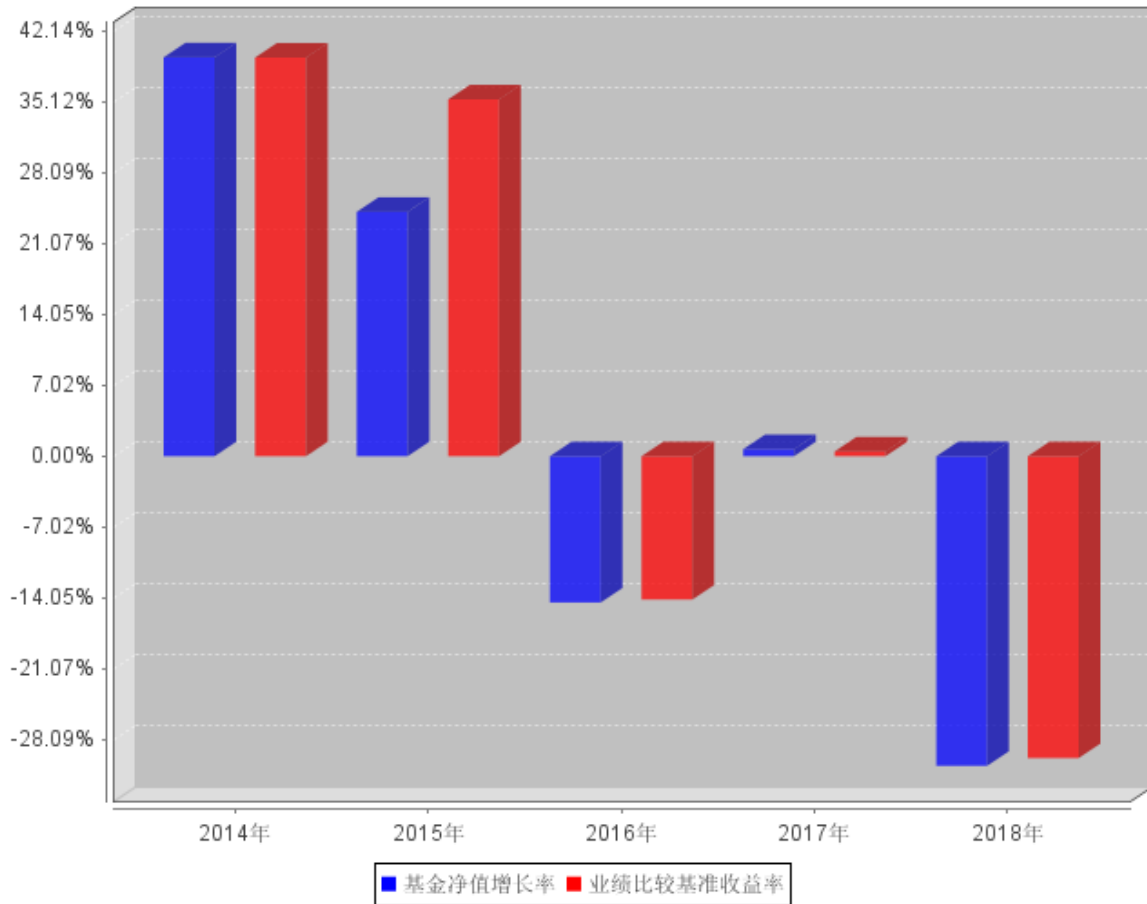
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

## §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 2.222 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 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业股份有限公司 0.90%，杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。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 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 111 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、银华永祥灵活配置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、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息技术量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混

合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金。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	-	19 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，2010 年 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，2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013 年 11 月 5 日	-	9 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

					<p>等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日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，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》，对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等，规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程，完善公平交易制度，确保各

投资组合享有公平的交易执行机会，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》，制定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》，规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制；明确了交易执行环节的集中交易制度，并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外，为了加强对异常交易行为的日常监控，本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》，规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人又对上述制度进行了修改完善，进一步修订了公平交易的范围，修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点，并强调了本基金管理人内部控制的要求，具体控制方法为：1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现，不掺杂任何的人为判断，所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行，公平交易程序自动启动；2、一般情况下，场外交易指令以组合的名义下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

##### 4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，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。

在投资决策环节，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。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2.2 同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

#### 4.3.3 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 3 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽管报告期间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。

在 2018 年中，随着贸易战的持续发酵叠加去杠杆带来的信用收缩，股票市场呈现出持续缩量下跌的走势。宏观经济层面，PPI、信贷等数据持续走低，企业盈利水平相应下行。市场中的避险情绪较为明显，主要宽基指数均为全年负收益。行业层面，餐饮旅游、银行、石油石化相对收益靠前，电子元器件、有色金属、传媒等行业排名靠后。

#### 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 0.652 元；本报告期基金份额净值增长率为-30.68%，业绩比较基准收益率为-29.91%。

### 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 2019 年我们认为，市场有望逐步改变 2018 年的单边下行趋势，在年内从磨底状态转向活跃。外部市场方面，随着美国经济转入下行周期，短期内会增加国内投资者的避险情绪；而国



内方面，从政策放松到企业利润的修复需要一定的时间周期。但长期来看，中美贸易战正在逐步走向缓和，国内经济的新旧更替也正在发生。经济复苏的酝酿过程，将渐进的提升投资者风险偏好，进而为市场带来活跃度和投资机会。而在此过程中，各行业龙头类公司仍将以其较强的经营能力和现金流水平，成为市场中获取超额收益的潜在品种。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同基金的特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。首先，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果，部门总监签字确认后，将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节，持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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，本基金存在连续六十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 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 12 月 31 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## §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“金融工具风险及管理”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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）审字第 60468687_A31 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注 7.4.2 对编制基础的说明。基金管理人根据《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》的规定为基金份额持有人编制财务报表，因此，财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供基金管理人向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他事项	无。
其他信息	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，

	我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制财务报表（包括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可接受的），并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>治理层负责监督银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师的姓名	王珊珊	贺 耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,615,228.74	3,101,969.55
结算备付金		585.22	110,278.77
存出保证金		5,327.26	3,811.20
交易性金融资产	7.4.7.2	26,434,865.26	47,988,652.41
其中：股票投资		26,434,865.26	47,988,652.41
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	531.03	679.81
应收股利		-	-
应收申购款		515.94	662.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		29,057,053.45	51,206,054.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,142.27	9.93
应付管理人报酬		25,139.02	43,064.03
应付托管费		5,027.79	8,612.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,705.92	2,584.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	395,033.62	395,000.04
负债合计		438,048.62	449,271.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	27,742,070.35	34,094,045.98
未分配利润	7.4.7.10	876,934.48	16,662,737.15
所有者权益合计		28,619,004.83	50,756,783.13
负债和所有者权益总计		29,057,053.45	51,206,054.48

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，800 分级份额净值为人民币 0.652 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.004 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.300 元；基金份额总额为 43,863,247.77 份，其中 800 分级份额为 40,022,773.77 份，中证 800A 份额为 1,920,237.00 份，中证 800B 份额为 1,920,237.00 份。

## 7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元



项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-11,451,347.74	2,679,718.05
1.利息收入		21,352.32	30,686.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,352.32	30,686.61
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）		-10,274,007.27	507,109.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,628,526.25	-13,002.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	354,518.98	520,111.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,213,644.26	2,134,265.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	14,951.47	7,656.82
<b>减：二、费用</b>		1,347,888.01	1,579,065.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	372,262.72	506,604.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	74,452.50	101,320.95
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	276,109.70	344,548.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	625,063.09	626,591.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,799,235.75	1,100,652.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,799,235.75	1,100,652.49

### 7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	34,094,045.98	16,662,737.15	50,756,783.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,799,235.75	-12,799,235.75
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）	-6,351,975.63	-2,986,566.92	-9,338,542.55
其中：1. 基金申购款	2,386,004.81	944,717.75	3,330,722.56
2. 基金赎回款	-8,737,980.44	-3,931,284.67	-12,669,265.11

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）	27,742,070.35	876,934.48	28,619,004.83
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	1,100,652.49	1,100,652.49
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）	788,857.19	-368,538.63	420,318.56
其中：1. 基金申购款	7,718,207.60	3,028,606.82	10,746,814.42
2. 基金赎回款	-6,929,350.41	-3,397,145.45	-10,326,495.86
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）	34,094,045.98	16,662,737.15	50,756,783.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]689 号《关于核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金募集的批复》的批准，由银华基金管理股份有限公司于 2013 年 10 月 9 日至 2013 年 10 月 30 日向社会公开募集。基金合同于 2013 年 11 月 5 日生效。首次设立募集规模为 458,328,703.92 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

基金份额包括银华中证 800 指数增强分级证券投资基金的基础份额（即“800 分级份额”）、银华中证 800 指数增强分级的稳健收益类份额（即“中证 800A 份额”）与银华中证 800 指数增强分级的积极收益类份额（即“中证 800B 份额”）。其中，中证 800A 份额、中证 800B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。银华中证 800 指数增强分级证券投资基金发售结束后，投资者场内认购的全部 800 分级份额将按 1:1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的中证 800A 份额和积极收益类的中证 800B 份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

在中证 800A 份额、800 分级份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，（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。）本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，中证 800A 份额和中证 800B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于中证 800A 份额期末的约定应得收益，即中证 800A 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 800 分级份额分配给中证 800A 份额持有人。800 分级份额持有人持有的每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得新增 800 分级份额的分配。持有场外 800 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 800 分级份额的分配；持有场内 800 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 800 分级份额的分配。经过上述份额折算，中证 800A 份额和 800 分级份额的基金份额

净值将相应调整。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 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上；当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元及以下。当 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额的基金份额净值均调整为 1 元。当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后 800 分级份额、中证 800A 份额和中证 800B 份额的基金份额净值均调整为 1 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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%—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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议《关于终止银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同以及中证 800A 份额、中证 800B 份额终止上市有关事项的议案》。本基金的基金管理人已于 2019 年 3 月 4 日发布《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。具体事宜详见本基金的相关公告。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 7.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照 7.4.2 所述的编制基础编制。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，

同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；



(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额

入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

根据《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《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，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。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 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。

#### 7.4.6.2 增值税

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，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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税

政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 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[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。

#### 7.4.6.4 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	2,615,228.74	3,101,969.55
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,615,228.74	3,101,969.55

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,925,896.87	26,434,865.26	-1,491,031.61
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	27,925,896.87	26,434,865.26	-1,491,031.61
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		48,266,039.76	47,988,652.41	-277,387.35
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		48,266,039.76	47,988,652.41	-277,387.35

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	527.82	628.48
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	-	49.40
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.81	0.23
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	2.40	1.70
合计	531.03	679.81

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,705.92	2,584.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,705.92	2,584.58

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	33.62	0.04
标的指数使用基点费	50,000.00	50,000.00
预提费用	345,000.00	345,000.00
合计	395,033.62	395,000.04

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,048,540.15	34,094,045.98

本期申购	3,264,936.00	2,138,801.51
本期赎回（以“-”号填列）	-13,271,616.30	-8,694,600.14
2018年12月3日 基金拆分 /份额折算前	42,041,859.85	27,538,247.35
基金拆分/份额折算变动份额	1,499,065.95	-
本期申购	390,908.80	247,203.30
本期赎回（以“-”号填列）	-68,586.83	-43,380.30
本期末	43,863,247.77	27,742,070.35

注：(1)如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

(2)根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登结”）的规定，本基金以2018年12月3日为份额折算基准日，对800分级份额以及中证800A份额实施了定期份额折算。具体情况详见本基金管理人的相关公告。

(3)根据基金合同规定，投资者可申购、赎回800分级份额，中证800A份额和中证800B份额只可在深交所上市交易，因此上表不再单独披露中证800A份额和中证800B份额的情况。

#### 7.4.7.10 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	5,539,486.14	11,123,251.01	16,662,737.15
本期利润	-11,585,591.49	-1,213,644.26	-12,799,235.75
本期基金份额交易 产生的变动数	-1,254,368.25	-1,732,198.67	-2,986,566.92
其中：基金申购款	170,341.41	774,376.34	944,717.75
基金赎回款	-1,424,709.66	-2,506,575.01	-3,931,284.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,300,473.60	8,177,408.08	876,934.48

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	18,728.36	26,018.40
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	2,531.97	4,030.86
其他	91.99	637.35
合计	21,352.32	30,686.61

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	223,602,835.98	277,933,421.83
减：卖出股票成本总额	234,231,362.23	277,946,424.31
买卖股票差价收入	-10,628,526.25	-13,002.48

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	354,518.98	520,111.92
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	354,518.98	520,111.92

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,213,644.26	2,134,265.18
——股票投资	-1,213,644.26	2,134,265.18
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,213,644.26	2,134,265.18

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,951.47	7,656.82

合计	14,951.47	7,656.82
----	-----------	----------

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	276,109.70	344,548.61
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	276,109.70	344,548.61

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
标的指数使用基点费	200,000.00	200,000.00
银行汇划费用	2,063.09	3,391.15
账户服务费	18,000.00	18,200.00
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	625,063.09	626,591.15

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议《关于终止银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同以及中证 800A 份额、中证 800B 份额终止上市有关事项的议案》。本基金的基金管理人已于 2019 年 3 月 4 日发布《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。具体事宜详见本基金的相关公告。

截至财务报表批准日，除以上情况外，本基金无其他需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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
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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
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
银华资本管理(珠海横琴)有限公司(注 1)	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

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。

注 1：由原银华财富资本管理(北京)有限公司于 2019 年 3 月 4 日更名为银华资本管理(珠海横琴)有限公司。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	372,262.72	506,604.85
其中：支付销售机构的客户维护费	53,843.46	77,102.07

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	74,452.50	101,320.95

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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日 ( 2013 年 11 月 5 日 ) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	22,735,065.19
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	810,653.60
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	23,545,718.79
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	58.83%

项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日 (	-	-	-

2013 年 11 月 5 日 ) 持有的基金份额			
期初持有的基金份额	-	-	22,169,716.93
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	565,348.26
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	22,735,065.19
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	47.05%

注：基金管理人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。对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

#### 7.4.10.4.2 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：无。

#### 7.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	2,615,228.74	18,728.36	3,101,969.55

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

**7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**7.4.12.2 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
000987	越秀金控	2018 年 12 月 25 日	重大事项	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	4,324	35,032.09	34,462.28	-
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	重大事项	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	6,798	38,636.91	34,057.98	-
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	2,100	33,812.04	33,621.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	10.03	-	-	2,726	55,759.18	27,341.78	-
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大事项	0.00	-	-	4,123	84,995.70	0.00	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无。



### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了

巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	2,615,228.74	-	-	-	-	-	2,615,228.74
结算备付金	585.22	-	-	-	-	-	585.22
存出保证金	5,327.26	-	-	-	-	-	5,327.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	26,434,865.26	26,434,865.26
应收利息	-	-	-	-	-	531.03	531.03
应收申购款	-	-	-	-	-	515.94	515.94
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,621,141.22	-	-	-	-	26,435,912.23	29,057,053.45
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	9,142.27	9,142.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,139.02	25,139.02
应付托管费	-	-	-	-	-	5,027.79	5,027.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,705.92	3,705.92
其他负债	-	-	-	-	-	395,033.62	395,033.62
负债总计	-	-	-	-	-	438,048.62	438,048.62
利率敏感度缺口	2,621,141.22	-	-	-	-	-25,997,863.61	28,619,004.83
上年度末 2017 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	3,101,969.55	-	-	-	-	-	3,101,969.55
结算备付金	110,278.77	-	-	-	-	-	110,278.77
存出保证金	3,811.20	-	-	-	-	-	3,811.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-47,988,652.41	47,988,652.41
应收利息	-	-	-	-	-	679.81	679.81
应收申购款	-	-	-	-	-	662.74	662.74
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,216,059.52	-	-	-	-	-47,989,994.96	51,206,054.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9.93	9.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,064.03	43,064.03
应付托管费	-	-	-	-	-	8,612.77	8,612.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,584.58	2,584.58
其他负债	-	-	-	-	-	395,000.04	395,000.04
负债总计	-	-	-	-	-	449,271.35	449,271.35
利率敏感度缺口	3,216,059.52	-	-	-	-	-47,540,723.61	50,756,783.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所

持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	26,434,865.26	92.37	47,988,652.41	94.55
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	26,434,865.26	92.37	47,988,652.41	94.55

#### 7.4.13.4.2.2 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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	+5%	1,459,789.24	2,614,340.39

	-5%	-1,459,789.24	-2,614,340.39
--	-----	---------------	---------------

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 26,305,382.22 元，属于第二层次的余额为人民币 129,483.04 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 47,426,290.50 元，第二层次人民币 562,361.91 元，第三层次人民币 0.00 元）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）

##### 7.4.14.2 承诺事项

无。

##### 7.4.14.3 其他事项

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 12 月 31 日。本基金的基金管理人已于 2019 年 3 月 4 日发布《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，会议审议《关于终止银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同以及中证 800A 份额、中证 800B 份额终止上市有关事项的议案》。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	26,434,865.26	90.98
	其中：股票	26,434,865.26	90.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,615,813.96	9.00
8	其他各项资产	6,374.23	0.02
9	合计	29,057,053.45	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	170,607.36	0.60
B	采矿业	1,097,954.64	3.84
C	制造业	13,483,932.30	47.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供	855,401.58	2.99

	应业		
E	建筑业	756,471.96	2.64
F	批发和零售业	1,372,404.76	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,216,625.35	4.25
H	住宿和餐饮业	67,596.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,879,798.01	6.57
J	金融业	2,368,936.63	8.28
K	房地产业	1,436,783.59	5.02
L	租赁和商务服务业	501,074.50	1.75
M	科学研究和技术服务业	64,048.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	221,849.29	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	35,609.40	0.12
Q	卫生和社会工作	137,275.80	0.48
R	文化、体育和娱乐业	606,459.45	2.12
S	综合	134,694.86	0.47
	合计	26,407,523.48	92.27

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,341.78	0.10
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		-
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	27,341.78	0.10

### 8.2.3 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港股通股票投资。

## 8.3 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

### 8.3.1 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	002002	鸿达兴业	26,000	74,880.00	0.26
2	601998	中信银行	12,600	68,670.00	0.24
3	000750	国海证券	15,492	67,545.12	0.24
4	601377	兴业证券	14,100	65,424.00	0.23



5	600519	贵州茅台	100	59,001.00	0.21
6	603288	海天味业	600	41,280.00	0.14
7	002252	上海莱士	4,800	38,448.00	0.13
8	601336	新华保险	900	38,016.00	0.13
9	002085	万丰奥威	4,900	37,975.00	0.13
10	600563	法拉电子	900	37,926.00	0.13
11	002304	洋河股份	400	37,888.00	0.13
12	600895	张江高科	2,500	37,375.00	0.13
13	600104	上汽集团	1,400	37,338.00	0.13
14	000975	银泰资源	3,660	37,295.40	0.13
15	000999	华润三九	1,500	37,290.00	0.13
16	600073	上海梅林	5,000	37,250.00	0.13
17	600498	烽火通信	1,300	37,011.00	0.13
18	000538	云南白药	500	36,980.00	0.13
19	002230	科大讯飞	1,500	36,960.00	0.13
20	600276	恒瑞医药	700	36,925.00	0.13
21	600277	亿利洁能	6,500	36,790.00	0.13
22	601019	山东出版	4,700	36,754.00	0.13
23	002032	苏泊尔	700	36,750.00	0.13
24	300144	宋城演艺	1,719	36,700.65	0.13
25	600143	金发科技	7,400	36,630.00	0.13
26	600887	伊利股份	1,600	36,608.00	0.13
27	000568	泸州老窖	900	36,594.00	0.13
28	600179	安通控股	5,500	36,575.00	0.13
29	600900	长江电力	2,300	36,524.00	0.13
30	002482	广田集团	6,300	36,477.00	0.13
31	002155	湖南黄金	4,644	36,455.40	0.13
32	600021	上海电力	4,500	36,450.00	0.13

33	600660	福耀玻璃	1,600	36,448.00	0.13
34	600570	恒生电子	700	36,386.00	0.13
35	600118	中国卫星	2,100	36,372.00	0.13
36	601877	正泰电器	1,500	36,360.00	0.13
37	600547	山东黄金	1,200	36,300.00	0.13
38	603899	晨光文具	1,200	36,300.00	0.13
39	600183	生益科技	3,600	36,216.00	0.13
40	000069	华侨城 A	5,700	36,195.00	0.13
41	002690	美亚光电	1,700	36,176.00	0.13
42	002475	立讯精密	2,570	36,134.20	0.13
43	603866	桃李面包	800	36,128.00	0.13
44	600161	天坛生物	1,700	36,125.00	0.13
45	601888	中国国旅	600	36,120.00	0.13
46	600737	中粮糖业	4,900	36,064.00	0.13
47	600489	中金黄金	4,200	36,036.00	0.13
48	600863	内蒙华电	15,600	36,036.00	0.13
49	600597	光明乳业	4,300	35,948.00	0.13
50	600869	智慧能源	7,400	35,890.00	0.13
51	002044	美年健康	2,400	35,880.00	0.13
52	002463	沪电股份	5,000	35,850.00	0.13
53	601869	长飞光纤	900	35,793.00	0.13
54	600332	白云山	1,000	35,760.00	0.12
55	600085	同仁堂	1,300	35,750.00	0.12
56	601928	凤凰传媒	4,500	35,730.00	0.12
57	600352	浙江龙盛	3,700	35,705.00	0.12
58	002142	宁波银行	2,200	35,684.00	0.12
59	600820	隧道股份	5,700	35,682.00	0.12
60	002470	金正大	5,642	35,657.44	0.12

61	603377	东方时尚	2,439	35,609.40	0.12
62	002358	森源电气	2,000	35,600.00	0.12
63	600755	厦门国贸	5,100	35,598.00	0.12
64	601901	方正证券	6,700	35,577.00	0.12
65	600750	江中药业	2,100	35,553.00	0.12
66	600674	川投能源	4,100	35,547.00	0.12
67	600614	鹏起科技	9,900	35,541.00	0.12
68	600009	上海机场	700	35,532.00	0.12
69	002050	三花智控	2,800	35,532.00	0.12
70	000998	隆平高科	2,400	35,520.00	0.12
71	002294	信立泰	1,700	35,513.00	0.12
72	002399	海普瑞	1,540	35,497.00	0.12
73	600079	人福医药	3,500	35,490.00	0.12
74	601689	拓普集团	2,400	35,472.00	0.12
75	603169	兰石重装	8,300	35,441.00	0.12
76	600886	国投电力	4,400	35,420.00	0.12
77	601933	永辉超市	4,500	35,415.00	0.12
78	601006	大秦铁路	4,300	35,389.00	0.12
79	300003	乐普医疗	1,700	35,377.00	0.12
80	002916	深南电路	441	35,354.97	0.12
81	600872	中炬高新	1,200	35,352.00	0.12
82	000848	承德露露	4,397	35,351.88	0.12
83	002465	海格通信	4,532	35,349.60	0.12
84	600298	安琪酵母	1,400	35,322.00	0.12
85	600640	号百控股	3,600	35,316.00	0.12
86	600053	九鼎投资	1,500	35,310.00	0.12
87	002223	鱼跃医疗	1,800	35,298.00	0.12
88	601989	中国重工	8,300	35,275.00	0.12

89	600566	济川药业	1,052	35,273.56	0.12
90	002281	光迅科技	1,312	35,240.32	0.12
91	600406	国电南瑞	1,900	35,207.00	0.12
92	000537	广宇发展	4,700	35,203.00	0.12
93	002544	杰赛科技	3,252	35,186.64	0.12
94	600585	海螺水泥	1,200	35,136.00	0.12
95	600373	中文传媒	2,700	35,127.00	0.12
96	600195	中牧股份	3,300	35,112.00	0.12
97	002422	科伦药业	1,700	35,105.00	0.12
98	002925	盈趣科技	800	35,104.00	0.12
99	603885	吉祥航空	2,800	35,084.00	0.12
100	600795	国电电力	13,700	35,072.00	0.12
101	600522	中天科技	4,300	35,045.00	0.12
102	002414	高德红外	1,626	35,040.30	0.12
103	002285	世联行	6,894	35,021.52	0.12
104	002672	东江环保	3,061	35,017.84	0.12
105	601098	中南传媒	2,800	35,000.00	0.12
106	000661	长春高新	200	35,000.00	0.12
107	002384	东山精密	3,100	34,999.00	0.12
108	601021	春秋航空	1,100	34,991.00	0.12
109	000681	视觉中国	1,500	34,980.00	0.12
110	000426	兴业矿业	7,023	34,974.54	0.12
111	000158	常山北明	6,700	34,974.00	0.12
112	002493	荣盛石化	3,465	34,961.85	0.12
113	600741	华域汽车	1,900	34,960.00	0.12
114	002093	国脉科技	4,795	34,955.55	0.12
115	600557	康缘药业	3,400	34,952.00	0.12
116	002434	万里扬	5,300	34,927.00	0.12

117	601288	农业银行	9,700	34,920.00	0.12
118	300134	大富科技	3,712	34,892.80	0.12
119	600993	马应龙	2,600	34,892.00	0.12
120	300122	智飞生物	900	34,884.00	0.12
121	600511	国药股份	1,500	34,875.00	0.12
122	600600	青岛啤酒	1,000	34,860.00	0.12
123	000625	长安汽车	5,289	34,854.51	0.12
124	600999	招商证券	2,600	34,840.00	0.12
125	603806	福斯特	1,300	34,840.00	0.12
126	600779	水井坊	1,100	34,837.00	0.12
127	600435	北方导航	4,700	34,827.00	0.12
128	002127	南极电商	4,631	34,825.12	0.12
129	600637	东方明珠	3,400	34,816.00	0.12
130	601600	中国铝业	9,800	34,790.00	0.12
131	600655	豫园股份	4,700	34,780.00	0.12
132	603025	大豪科技	3,119	34,776.85	0.12
133	601333	广深铁路	11,000	34,760.00	0.12
134	002311	海大集团	1,500	34,755.00	0.12
135	600312	平高电气	4,300	34,744.00	0.12
136	601328	交通银行	6,000	34,740.00	0.12
137	002299	圣农发展	2,100	34,734.00	0.12
138	300450	先导智能	1,200	34,728.00	0.12
139	600126	杭钢股份	7,700	34,727.00	0.12
140	600875	东方电气	4,400	34,716.00	0.12
141	002563	森马服饰	3,891	34,707.72	0.12
142	002505	大康农业	21,424	34,706.88	0.12
143	001979	招商蛇口	2,000	34,700.00	0.12
144	600064	南京高科	4,400	34,672.00	0.12

145	000536	华映科技	18,541	34,671.67	0.12
146	600996	贵广网络	5,451	34,668.36	0.12
147	600436	片仔癀	400	34,660.00	0.12
148	600350	山东高速	7,600	34,656.00	0.12
149	600718	东软集团	3,000	34,650.00	0.12
150	601991	大唐发电	11,000	34,650.00	0.12
151	600827	百联股份	4,100	34,645.00	0.12
152	000600	建投能源	6,900	34,638.00	0.12
153	002244	滨江集团	8,702	34,633.96	0.12
154	600383	金地集团	3,600	34,632.00	0.12
155	002174	游族网络	1,862	34,614.58	0.12
156	300296	利亚德	4,500	34,605.00	0.12
157	000418	小天鹅 A	800	34,600.00	0.12
158	300136	信维通信	1,600	34,576.00	0.12
159	600535	天士力	1,800	34,560.00	0.12
160	002507	涪陵榨菜	1,600	34,560.00	0.12
161	000100	TCL 集团	14,104	34,554.80	0.12
162	001965	招商公路	4,300	34,529.00	0.12
163	600023	浙能电力	7,300	34,529.00	0.12
164	002254	泰和新材	3,185	34,525.40	0.12
165	002001	新和成	2,300	34,523.00	0.12
166	300017	网宿科技	4,408	34,514.64	0.12
167	600376	首开股份	4,800	34,512.00	0.12
168	600388	龙净环保	3,400	34,510.00	0.12
169	002714	牧原股份	1,200	34,500.00	0.12
170	000063	中兴通讯	1,760	34,478.40	0.12
171	000987	越秀金控	4,324	34,462.28	0.12
172	002602	世纪华通	1,668	34,444.20	0.12

173	000049	德赛电池	1,200	34,416.00	0.12
174	601818	光大银行	9,300	34,410.00	0.12
175	603355	莱克电气	1,600	34,400.00	0.12
176	000963	华东医药	1,300	34,398.00	0.12
177	601939	建设银行	5,400	34,398.00	0.12
178	000938	紫光股份	1,100	34,386.00	0.12
179	601398	工商银行	6,500	34,385.00	0.12
180	601127	小康股份	2,006	34,382.84	0.12
181	300033	同花顺	900	34,380.00	0.12
182	600066	宇通客车	2,900	34,365.00	0.12
183	601166	兴业银行	2,300	34,362.00	0.12
184	603868	飞科电器	900	34,362.00	0.12
185	600037	歌华有线	4,000	34,360.00	0.12
186	600648	外高桥	2,500	34,350.00	0.12
187	600704	物产中大	7,500	34,350.00	0.12
188	600271	航天信息	1,500	34,335.00	0.12
189	300253	卫宁健康	2,755	34,327.30	0.12
190	002468	申通快递	2,086	34,314.70	0.12
191	600611	大众交通	8,600	34,314.00	0.12
192	600125	铁龙物流	4,900	34,300.00	0.12
193	600025	华能水电	10,885	34,287.75	0.12
194	002056	横店东磁	6,200	34,286.00	0.12
195	300115	长盈精密	4,185	34,275.15	0.12
196	603568	伟明环保	1,500	34,275.00	0.12
197	601985	中国核电	6,500	34,255.00	0.12
198	002019	亿帆医药	3,200	34,240.00	0.12
199	002815	崇达技术	2,343	34,231.23	0.12
200	000876	新希望	4,702	34,230.56	0.12

201	000829	天音控股	6,100	34,221.00	0.12
202	600606	绿地控股	5,600	34,216.00	0.12
203	600362	江西铜业	2,600	34,216.00	0.12
204	300383	光环新网	2,700	34,209.00	0.12
205	000008	神州高铁	8,793	34,204.77	0.12
206	300347	泰格医药	800	34,200.00	0.12
207	000725	京东方 A	13,002	34,195.26	0.12
208	600031	三一重工	4,100	34,194.00	0.12
209	000776	广发证券	2,696	34,185.28	0.12
210	601200	上海环境	2,575	34,170.25	0.12
211	000089	深圳机场	4,385	34,159.15	0.12
212	600418	江淮汽车	7,100	34,151.00	0.12
213	002439	启明星辰	1,660	34,129.60	0.12
214	002444	巨星科技	3,600	34,128.00	0.12
215	002424	贵州百灵	3,900	34,125.00	0.12
216	600050	中国联通	6,600	34,122.00	0.12
217	002372	伟星新材	2,200	34,122.00	0.12
218	601601	中国太保	1,200	34,116.00	0.12
219	600645	中源协和	2,100	34,104.00	0.12
220	600487	亨通光电	2,000	34,100.00	0.12
221	002670	国盛金控	3,382	34,090.56	0.12
222	600588	用友网络	1,600	34,080.00	0.12
223	600754	锦江股份	1,600	34,080.00	0.12
224	002773	康弘药业	1,000	34,070.00	0.12
225	600366	宁波韵升	6,800	34,068.00	0.12
226	601801	皖新传媒	5,100	34,068.00	0.12
227	601608	中信重工	13,100	34,060.00	0.12
228	002183	怡亚通	6,798	34,057.98	0.12



229	600151	航天机电	8,600	34,056.00	0.12
230	600266	北京城建	4,300	34,056.00	0.12
231	601880	大连港	18,400	34,040.00	0.12
232	600545	卓郎智能	4,600	34,040.00	0.12
233	000858	五粮液	669	34,038.72	0.12
234	002152	广电运通	6,067	34,035.87	0.12
235	601669	中国电建	7,000	34,020.00	0.12
236	601688	华泰证券	2,100	34,020.00	0.12
237	600380	健康元	5,100	34,017.00	0.12
238	601828	美凯龙	3,081	34,014.24	0.12
239	002831	裕同科技	849	34,010.94	0.12
240	600233	圆通速递	3,400	34,000.00	0.12
241	601607	上海医药	2,000	34,000.00	0.12
242	000543	皖能电力	7,097	33,994.63	0.12
243	600015	华夏银行	4,600	33,994.00	0.12
244	002371	北方华创	900	33,984.00	0.12
245	300146	汤臣倍健	2,000	33,980.00	0.12
246	600664	哈药股份	8,600	33,970.00	0.12
247	000988	华工科技	2,845	33,969.30	0.12
248	002416	爱施德	5,777	33,968.76	0.12
249	000813	德展健康	3,700	33,966.00	0.12
250	600643	爱建集团	4,000	33,960.00	0.12
251	600098	广州发展	6,000	33,960.00	0.12
252	600729	重庆百货	1,200	33,960.00	0.12
253	600141	兴发集团	3,300	33,957.00	0.12
254	601238	广汽集团	3,300	33,957.00	0.12
255	600089	特变电工	5,000	33,950.00	0.12
256	600011	华能国际	4,600	33,948.00	0.12

257	000959	首钢股份	9,100	33,943.00	0.12
258	002242	九阳股份	2,120	33,941.20	0.12
259	002221	东华能源	4,211	33,940.66	0.12
260	600056	中国医药	2,700	33,939.00	0.12
261	601919	中远海控	8,400	33,936.00	0.12
262	600623	华谊集团	4,200	33,936.00	0.12
263	600717	天津港	4,800	33,936.00	0.12
264	000895	双汇发展	1,438	33,922.42	0.12
265	002506	协鑫集成	6,784	33,920.00	0.12
266	600398	海澜之家	4,000	33,920.00	0.12
267	600808	马钢股份	9,800	33,908.00	0.12
268	600757	长江传媒	5,200	33,904.00	0.12
269	600859	王府井	2,500	33,900.00	0.12
270	601618	中国中冶	10,900	33,899.00	0.12
271	600466	蓝光发展	6,300	33,894.00	0.12
272	603228	景旺电子	678	33,893.22	0.12
273	002212	南洋股份	3,047	33,882.64	0.12
274	600694	大商股份	1,400	33,866.00	0.12
275	603198	迎驾贡酒	2,400	33,864.00	0.12
276	000898	鞍钢股份	6,600	33,858.00	0.12
277	000656	金科股份	5,469	33,853.11	0.12
278	600415	小商品城	9,700	33,853.00	0.12
279	600062	华润双鹤	2,800	33,852.00	0.12
280	600060	海信电器	3,900	33,852.00	0.12
281	002013	中航机电	5,200	33,852.00	0.12
282	600216	浙江医药	3,900	33,852.00	0.12
283	002701	奥瑞金	6,690	33,851.40	0.12
284	000937	冀中能源	8,979	33,850.83	0.12

285	000778	新兴铸管	7,854	33,850.74	0.12
286	002266	浙富控股	8,317	33,850.19	0.12
287	000002	万科 A	1,421	33,848.22	0.12
288	600006	东风汽车	9,400	33,840.00	0.12
289	300408	三环集团	2,000	33,840.00	0.12
290	600885	宏发股份	1,500	33,840.00	0.12
291	603712	七一二	1,900	33,839.00	0.12
292	300015	爱尔眼科	1,286	33,821.80	0.12
293	300459	金科文化	4,600	33,810.00	0.12
294	600016	民生银行	5,900	33,807.00	0.12
295	600572	康恩贝	5,700	33,801.00	0.12
296	600019	宝钢股份	5,200	33,800.00	0.12
297	600426	华鲁恒升	2,800	33,796.00	0.12
298	600177	雅戈尔	4,700	33,793.00	0.12
299	601997	贵阳银行	3,164	33,791.52	0.12
300	600158	中体产业	3,800	33,782.00	0.12
301	002558	巨人网络	1,744	33,781.28	0.12
302	600639	浦东金桥	3,000	33,780.00	0.12
303	002440	闰土股份	3,753	33,777.00	0.12
304	601128	常熟银行	5,500	33,770.00	0.12
305	000001	平安银行	3,600	33,768.00	0.12
306	601678	滨化股份	8,000	33,760.00	0.12
307	603225	新凤鸣	1,800	33,750.00	0.12
308	000718	苏宁环球	10,612	33,746.16	0.12
309	601958	金钼股份	5,700	33,744.00	0.12
310	002400	省广集团	11,400	33,744.00	0.12
311	600977	中国电影	2,356	33,737.92	0.12
312	601899	紫金矿业	10,100	33,734.00	0.12

313	601717	郑煤机	6,100	33,733.00	0.12
314	603877	太平鸟	1,795	33,728.05	0.12
315	600027	华电国际	7,100	33,725.00	0.12
316	601211	国泰君安	2,200	33,704.00	0.12
317	600297	广汇汽车	8,300	33,698.00	0.12
318	000623	吉林敖东	2,335	33,694.05	0.12
319	002179	中航光电	1,000	33,680.00	0.12
320	002251	步步高	4,539	33,679.38	0.12
321	601100	恒立液压	1,700	33,677.00	0.12
322	600642	申能股份	6,900	33,672.00	0.12
323	600017	日照港	12,200	33,672.00	0.12
324	600594	益佰制药	6,100	33,672.00	0.12
325	600018	上港集团	6,500	33,670.00	0.12
326	600926	杭州银行	4,550	33,670.00	0.12
327	601318	中国平安	600	33,660.00	0.12
328	603328	依顿电子	3,400	33,660.00	0.12
329	000408	藏格控股	3,000	33,660.00	0.12
330	002625	光启技术	3,400	33,660.00	0.12
331	603888	新华网	2,621	33,653.64	0.12
332	603556	海兴电力	2,588	33,644.00	0.12
333	600208	新湖中宝	11,600	33,640.00	0.12
334	002368	太极股份	1,450	33,640.00	0.12
335	600157	永泰能源	25,100	33,634.00	0.12
336	600170	上海建工	11,100	33,633.00	0.12
337	600919	江苏银行	5,633	33,629.01	0.12
338	600316	洪都航空	3,400	33,626.00	0.12
339	600038	中直股份	900	33,624.00	0.12
340	600171	上海贝岭	3,600	33,624.00	0.12

341	000826	启迪桑德	3,236	33,622.04	0.12
342	600030	中信证券	2,100	33,621.00	0.12
343	002233	塔牌集团	3,342	33,620.52	0.12
344	601138	工业富联	2,900	33,611.00	0.12
345	002352	顺丰控股	1,026	33,601.50	0.12
346	601633	长城汽车	6,000	33,600.00	0.12
347	600528	中铁工业	3,200	33,600.00	0.12
348	601179	中国西电	10,000	33,600.00	0.12
349	000541	佛山照明	6,485	33,592.30	0.12
350	601727	上海电气	6,800	33,592.00	0.12
351	601009	南京银行	5,200	33,592.00	0.12
352	600309	万华化学	1,200	33,588.00	0.12
353	300257	开山股份	3,362	33,586.38	0.12
354	002202	金风科技	3,362	33,586.38	0.12
355	000667	美好置业	13,433	33,582.50	0.12
356	600998	九州通	2,300	33,580.00	0.12
357	603000	人民网	4,600	33,580.00	0.12
358	002118	紫鑫药业	7,700	33,572.00	0.12
359	300168	万达信息	2,800	33,572.00	0.12
360	601229	上海银行	3,000	33,570.00	0.12
361	002603	以岭药业	3,209	33,566.14	0.12
362	002344	海宁皮城	7,375	33,556.25	0.12
363	601311	骆驼股份	3,800	33,554.00	0.12
364	600478	科力远	8,600	33,540.00	0.12
365	600259	广晟有色	1,500	33,540.00	0.12
366	600565	迪马股份	12,900	33,540.00	0.12
367	600908	无锡银行	6,400	33,536.00	0.12
368	002074	国轩高科	2,900	33,524.00	0.12

369	601866	中远海发	14,700	33,516.00	0.12
370	600258	首旅酒店	2,100	33,516.00	0.12
371	000400	许继电气	3,770	33,515.30	0.12
372	600138	中青旅	2,600	33,514.00	0.12
373	002624	完美世界	1,203	33,503.55	0.12
374	600068	葛洲坝	5,300	33,496.00	0.12
375	000025	特力 A	1,263	33,494.76	0.12
376	002007	华兰生物	1,021	33,488.80	0.12
377	002415	海康威视	1,300	33,488.00	0.12
378	000028	国药一致	808	33,483.52	0.12
379	600765	中航重机	4,500	33,480.00	0.12
380	002640	跨境通	3,100	33,480.00	0.12
381	601225	陕西煤业	4,500	33,480.00	0.12
382	600325	华发股份	5,400	33,480.00	0.12
383	002491	通鼎互联	4,248	33,474.24	0.12
384	600958	东方证券	4,200	33,474.00	0.12
385	600739	辽宁成大	3,200	33,472.00	0.12
386	002250	联化科技	3,549	33,467.07	0.12
387	002241	歌尔股份	4,864	33,464.32	0.12
388	600917	重庆燃气	4,700	33,464.00	0.12
389	600823	世茂股份	8,900	33,464.00	0.12
390	600221	海航控股	17,800	33,464.00	0.12
391	601198	东兴证券	3,500	33,460.00	0.12
392	000598	兴蓉环境	8,302	33,457.06	0.12
393	002589	瑞康医药	4,800	33,456.00	0.12
394	600167	联美控股	3,700	33,448.00	0.12
395	603515	欧普照明	1,200	33,444.00	0.12
396	600575	皖江物流	15,700	33,441.00	0.12

397	603658	安图生物	684	33,440.76	0.12
398	600801	华新水泥	2,000	33,440.00	0.12
399	002268	卫士通	1,872	33,433.92	0.12
400	600688	上海石化	6,700	33,433.00	0.12
401	000060	中金岭南	8,442	33,430.32	0.12
402	000401	冀东水泥	2,700	33,426.00	0.12
403	600516	方大炭素	2,000	33,420.00	0.12
404	000877	天山股份	4,700	33,417.00	0.12
405	600633	浙数文化	4,100	33,415.00	0.12
406	002317	众生药业	4,000	33,400.00	0.12
407	601018	宁波港	10,000	33,400.00	0.12
408	601838	成都银行	4,149	33,399.45	0.12
409	002008	大族激光	1,100	33,396.00	0.12
410	000887	中鼎股份	3,300	33,396.00	0.12
411	002807	江阴银行	6,573	33,390.84	0.12
412	600580	卧龙电气	5,300	33,390.00	0.12
413	600567	山鹰纸业	10,700	33,384.00	0.12
414	600598	北大荒	3,900	33,384.00	0.12
415	002028	思源电气	3,382	33,380.34	0.12
416	000338	潍柴动力	4,335	33,379.50	0.12
417	002048	宁波华翔	3,200	33,376.00	0.12
418	300244	迪安诊断	2,200	33,374.00	0.12
419	601766	中国中车	3,700	33,374.00	0.12
420	603077	和邦生物	20,600	33,372.00	0.12
421	600649	城投控股	6,100	33,367.00	0.12
422	000926	福星股份	5,451	33,360.12	0.12
423	600867	通化东宝	2,400	33,360.00	0.12
424	000630	铜陵有色	16,925	33,342.25	0.12

425	002191	劲嘉股份	4,269	33,340.89	0.12
426	000738	航发控制	2,764	33,333.84	0.12
427	002120	韵达股份	1,100	33,330.00	0.12
428	603369	今世缘	2,300	33,327.00	0.12
429	000519	中兵红箭	5,298	33,324.42	0.12
430	600000	浦发银行	3,400	33,320.00	0.12
431	601000	唐山港	14,000	33,320.00	0.12
432	601966	玲珑轮胎	2,441	33,319.65	0.12
433	002024	苏宁易购	3,382	33,312.70	0.12
434	300413	芒果超媒	900	33,309.00	0.12
435	600811	东方集团	9,100	33,306.00	0.12
436	002681	奋达科技	9,100	33,306.00	0.12
437	300133	华策影视	3,716	33,295.36	0.12
438	000636	风华高科	3,100	33,294.00	0.12
439	000039	中集集团	3,146	33,284.68	0.12
440	601326	秦港股份	10,600	33,284.00	0.12
441	000166	申万宏源	8,177	33,280.39	0.12
442	600967	内蒙一机	3,200	33,280.00	0.12
443	000027	深圳能源	6,339	33,279.75	0.12
444	002065	东华软件	4,788	33,276.60	0.12
445	601216	君正集团	12,700	33,274.00	0.12
446	600008	首创股份	9,700	33,271.00	0.12
447	000709	河钢股份	11,713	33,264.92	0.12
448	000612	焦作万方	8,400	33,264.00	0.12
449	600839	四川长虹	14,400	33,264.00	0.12
450	603156	养元饮品	800	33,264.00	0.12
451	002276	万马股份	6,600	33,264.00	0.12
452	600690	青岛海尔	2,400	33,240.00	0.12



453	000685	中山公用	4,748	33,236.00	0.12
454	600307	酒钢宏兴	17,400	33,234.00	0.12
455	600458	时代新材	4,900	33,222.00	0.12
456	600971	恒源煤电	5,900	33,217.00	0.12
457	002601	龙蟠佰利	2,700	33,210.00	0.12
458	002081	金螳螂	4,100	33,210.00	0.12
459	000878	云南铜业	4,185	33,187.05	0.12
460	000031	中粮地产	6,800	33,184.00	0.12
461	603659	璞泰来	700	33,180.00	0.12
462	000501	鄂武商 A	3,500	33,180.00	0.12
463	600409	三友化工	5,800	33,176.00	0.12
464	601168	西部矿业	5,700	33,174.00	0.12
465	600282	南钢股份	9,700	33,174.00	0.12
466	002131	利欧股份	22,567	33,173.49	0.12
467	601155	新城控股	1,400	33,166.00	0.12
468	601857	中国石油	4,600	33,166.00	0.12
469	601718	际华集团	9,900	33,165.00	0.12
470	600004	白云机场	3,300	33,165.00	0.12
471	601969	海南矿业	7,400	33,152.00	0.12
472	600428	中远海特	10,200	33,150.00	0.12
473	601777	力帆股份	8,700	33,147.00	0.12
474	002583	海能达	4,200	33,138.00	0.12
475	601012	隆基股份	1,900	33,136.00	0.12
476	600153	建发股份	4,700	33,135.00	0.12
477	600039	四川路桥	10,100	33,128.00	0.12
478	600219	南山铝业	15,700	33,127.00	0.12
479	600022	山东钢铁	21,100	33,127.00	0.12
480	600346	恒力股份	2,500	33,125.00	0.12

481	000488	晨鸣纸业	5,904	33,121.44	0.12
482	600438	通威股份	4,000	33,120.00	0.12
483	002460	赣锋锂业	1,500	33,120.00	0.12
484	002707	众信旅游	5,240	33,116.80	0.12
485	601106	中国一重	12,400	33,108.00	0.12
486	600748	上实发展	6,200	33,108.00	0.12
487	000012	南玻 A	8,297	33,105.03	0.12
488	603056	德邦股份	2,000	33,100.00	0.12
489	601169	北京银行	5,900	33,099.00	0.12
490	000627	天茂集团	5,900	33,099.00	0.12
491	600618	氯碱化工	5,100	33,099.00	0.12
492	600901	江苏租赁	5,600	33,096.00	0.12
493	002635	安洁科技	2,921	33,094.93	0.12
494	002078	太阳纸业	5,806	33,094.20	0.12
495	600848	上海临港	1,600	33,088.00	0.12
496	600782	新钢股份	6,500	33,085.00	0.12
497	600340	华夏幸福	1,300	33,085.00	0.12
498	600100	同方股份	3,400	33,082.00	0.12
499	300316	晶盛机电	3,300	33,066.00	0.12
500	000723	美锦能源	10,300	33,063.00	0.12
501	601668	中国建筑	5,800	33,060.00	0.12
502	603569	长久物流	3,075	33,056.25	0.12
503	603883	老百姓	700	33,047.00	0.12
504	600804	鹏博士	4,700	33,041.00	0.12
505	000839	中信国安	9,800	33,026.00	0.12
506	603260	合盛硅业	754	33,025.20	0.12
507	002340	格林美	8,600	33,024.00	0.12
508	000157	中联重科	9,274	33,015.44	0.12

509	601898	中煤能源	7,100	33,015.00	0.12
510	600048	保利地产	2,800	33,012.00	0.12
511	600657	信达地产	8,400	33,012.00	0.12
512	600879	航天电子	6,100	33,001.00	0.12
513	600874	创业环保	4,000	33,000.00	0.12
514	600787	中储股份	6,600	33,000.00	0.12
515	002249	大洋电机	10,000	33,000.00	0.12
516	601020	华钰矿业	3,900	32,994.00	0.12
517	002273	水晶光电	3,451	32,991.56	0.12
518	300001	特锐德	1,882	32,991.46	0.12
519	000061	农产品	6,800	32,980.00	0.12
520	000078	海王生物	11,062	32,964.76	0.12
521	000563	陕国投 A	12,300	32,964.00	0.12
522	600959	江苏有线	8,000	32,960.00	0.12
523	002195	二三四五	8,932	32,959.08	0.12
524	002736	国信证券	3,936	32,944.32	0.12
525	601016	节能风电	14,200	32,944.00	0.12
526	000983	西山煤电	6,000	32,940.00	0.12
527	002129	中环股份	4,556	32,939.88	0.12
528	600109	国金证券	4,600	32,936.00	0.12
529	600291	西水股份	3,200	32,928.00	0.12
530	000333	美的集团	893	32,915.98	0.12
531	600743	华远地产	13,600	32,912.00	0.12
532	000980	众泰汽车	7,600	32,908.00	0.11
533	601992	金隅集团	9,400	32,900.00	0.11
534	002407	多氟多	3,000	32,880.00	0.11
535	002509	天广中茂	13,873	32,879.01	0.11
536	601001	大同煤业	7,700	32,879.00	0.11

537	000553	沙隆达 A	3,600	32,868.00	0.11
538	601228	广州港	8,300	32,868.00	0.11
539	002277	友阿股份	10,400	32,864.00	0.11
540	603858	步长制药	1,300	32,864.00	0.11
541	000758	中色股份	9,003	32,860.95	0.11
542	002426	胜利精密	14,163	32,858.16	0.11
543	601390	中国中铁	4,700	32,853.00	0.11
544	601111	中国国航	4,300	32,852.00	0.11
545	601003	柳钢股份	5,000	32,850.00	0.11
546	000402	金融街	5,100	32,844.00	0.11
547	000425	徐工机械	10,165	32,832.95	0.11
548	002064	华峰氨纶	7,836	32,832.84	0.11
549	000703	恒逸石化	2,850	32,832.00	0.11
550	600500	中化国际	4,800	32,832.00	0.11
551	002408	齐翔腾达	4,800	32,832.00	0.11
552	601555	东吴证券	4,900	32,830.00	0.11
553	600970	中材国际	6,000	32,820.00	0.11
554	002818	富森美	1,578	32,806.62	0.11
555	002128	露天煤业	4,581	32,799.96	0.11
556	000581	威孚高科	1,857	32,794.62	0.11
557	600169	太原重工	14,700	32,781.00	0.11
558	300026	红日药业	10,746	32,775.30	0.11
559	000768	中航飞机	2,475	32,769.00	0.11
560	600673	东阳光科	4,500	32,760.00	0.11
561	600036	招商银行	1,300	32,760.00	0.11
562	600315	上海家化	1,200	32,760.00	0.11
563	600348	阳泉煤业	6,500	32,760.00	0.11
564	601212	白银有色	11,100	32,745.00	0.11

565	002375	亚厦股份	6,497	32,744.88	0.11
566	000727	华东科技	22,270	32,736.90	0.11
567	300251	光线传媒	4,307	32,733.20	0.11
568	600086	东方金钰	7,100	32,731.00	0.11
569	601108	财通证券	4,532	32,721.04	0.11
570	600267	海正药业	3,900	32,721.00	0.11
571	600392	盛和资源	3,800	32,718.00	0.11
572	600256	广汇能源	8,700	32,712.00	0.11
573	000729	燕京啤酒	5,800	32,712.00	0.11
574	600390	五矿资本	4,700	32,712.00	0.11
575	600699	均胜电子	1,400	32,704.00	0.11
576	000671	阳光城	6,300	32,697.00	0.11
577	601811	新华文轩	3,512	32,696.72	0.11
578	601117	中国化学	6,100	32,696.00	0.11
579	300024	机器人	2,473	32,693.06	0.11
580	002588	史丹利	8,400	32,676.00	0.11
581	300010	立思辰	4,500	32,670.00	0.11
582	300059	东方财富	2,700	32,670.00	0.11
583	300027	华谊兄弟	6,965	32,665.85	0.11
584	600120	浙江东方	2,600	32,656.00	0.11
585	601800	中国交建	2,900	32,654.00	0.11
586	600939	重庆建工	7,082	32,648.02	0.11
587	600705	中航资本	7,700	32,648.00	0.11
588	000997	新大陆	2,230	32,647.20	0.11
589	000564	供销大集	12,900	32,637.00	0.11
590	000006	深振业 A	6,300	32,634.00	0.11
591	000969	安泰科技	7,172	32,632.60	0.11
592	601628	中国人寿	1,600	32,624.00	0.11

593	600549	厦门钨业	2,700	32,616.00	0.11
594	601186	中国铁建	3,000	32,610.00	0.11
595	000021	深科技	5,670	32,602.50	0.11
596	002503	搜于特	13,873	32,601.55	0.11
597	002146	荣盛发展	4,100	32,595.00	0.11
598	000690	宝新能源	4,843	32,593.39	0.11
599	000807	云铝股份	8,400	32,592.00	0.11
600	000783	长江证券	6,327	32,584.05	0.11
601	000552	靖远煤电	12,726	32,578.56	0.11
602	600196	复星医药	1,400	32,578.00	0.11
603	601881	中国银河	4,775	32,565.50	0.11
604	600837	海通证券	3,700	32,560.00	0.11
605	300308	中际旭创	800	32,552.00	0.11
606	600058	五矿发展	5,000	32,550.00	0.11
607	300202	聚龙股份	5,053	32,541.32	0.11
608	600909	华安证券	6,894	32,539.68	0.11
609	600029	南方航空	4,900	32,536.00	0.11
610	000156	华数传媒	4,100	32,513.00	0.11
611	300274	阳光电源	3,644	32,504.48	0.11
612	600770	综艺股份	6,900	32,499.00	0.11
613	002920	德赛西威	1,873	32,496.55	0.11
614	002332	仙琚制药	5,300	32,489.00	0.11
615	600160	巨化股份	4,900	32,487.00	0.11
616	600188	兖州煤业	3,700	32,486.00	0.11
617	600094	大名城	8,900	32,485.00	0.11
618	300291	华录百纳	7,300	32,485.00	0.11
619	600862	中航高科	5,800	32,480.00	0.11
620	600460	士兰微	4,000	32,480.00	0.11

621	000547	航天发展	4,296	32,477.76	0.11
622	002051	中工国际	2,931	32,475.48	0.11
623	601872	招商轮船	8,800	32,472.00	0.11
624	600777	新潮能源	17,000	32,470.00	0.11
625	002041	登海种业	6,024	32,469.36	0.11
626	601808	中海油服	3,800	32,452.00	0.11
627	600372	中航电子	2,500	32,450.00	0.11
628	600111	北方稀土	3,700	32,449.00	0.11
629	601788	光大证券	3,700	32,449.00	0.11
630	002642	荣之联	5,038	32,444.72	0.11
631	002500	山西证券	5,478	32,429.76	0.11
632	000990	诚志股份	2,700	32,427.00	0.11
633	300376	易事特	7,700	32,417.00	0.11
634	600010	包钢股份	21,900	32,412.00	0.11
635	000413	东旭光电	7,202	32,409.00	0.11
636	002663	普邦股份	13,120	32,406.40	0.11
637	000761	本钢板材	9,644	32,403.84	0.11
638	600201	生物股份	1,952	32,403.20	0.11
639	601231	环旭电子	3,600	32,400.00	0.11
640	601005	重庆钢铁	16,700	32,398.00	0.11
641	000960	锡业股份	3,396	32,397.84	0.11
642	000559	万向钱潮	6,327	32,394.24	0.11
643	002092	中泰化学	4,593	32,380.65	0.11
644	600155	华创阳安	4,300	32,379.00	0.11
645	000596	古井贡酒	600	32,376.00	0.11
646	600061	国投资本	3,600	32,364.00	0.11
647	300058	蓝色光标	7,456	32,359.04	0.11
648	000009	中国宝安	7,506	32,350.86	0.11

649	600329	中新药业	2,600	32,344.00	0.11
650	000830	鲁西化工	3,300	32,340.00	0.11
651	600583	海油工程	6,600	32,340.00	0.11
652	603993	洛阳钼业	8,600	32,336.00	0.11
653	601088	中国神华	1,800	32,328.00	0.11
654	002665	首航节能	11,500	32,315.00	0.11
655	603766	隆鑫通用	7,900	32,311.00	0.11
656	600884	杉杉股份	2,500	32,300.00	0.11
657	600115	东方航空	6,800	32,300.00	0.11
658	002110	三钢闽光	2,525	32,294.75	0.11
659	002839	张家港行	6,034	32,281.90	0.11
660	300159	新研股份	7,000	32,270.00	0.11
661	002004	华邦健康	7,000	32,270.00	0.11
662	601360	三六零	1,584	32,266.08	0.11
663	000732	泰禾集团	2,300	32,246.00	0.11
664	600260	凯乐科技	1,900	32,243.00	0.11
665	000766	通化金马	4,700	32,242.00	0.11
666	600184	光电股份	3,300	32,241.00	0.11
667	300124	汇川技术	1,600	32,224.00	0.11
668	603486	科沃斯	700	32,221.00	0.11
669	002373	千方科技	2,896	32,203.52	0.11
670	002345	潮宏基	7,202	32,192.94	0.11
671	300002	神州泰岳	9,755	32,191.50	0.11
672	300297	蓝盾股份	6,436	32,180.00	0.11
673	600280	中央商场	9,900	32,175.00	0.11
674	002359	北讯集团	3,918	32,166.78	0.11
675	000415	渤海租赁	8,932	32,155.20	0.11
676	002411	延安必康	1,525	32,147.00	0.11



677	002038	双鹭药业	1,295	32,128.95	0.11
678	000651	格力电器	900	32,121.00	0.11
679	000513	丽珠集团	1,277	32,116.55	0.11
680	300166	东方国信	3,100	32,116.00	0.11
681	000712	锦龙股份	3,534	32,088.72	0.11
682	002236	大华股份	2,800	32,088.00	0.11
683	000930	中粮生化	4,324	32,084.08	0.11
684	002390	信邦制药	7,836	32,049.24	0.11
685	600503	华丽家族	10,500	32,025.00	0.11
686	600835	上海机电	2,200	32,010.00	0.11
687	002385	大北农	10,000	32,000.00	0.11
688	600416	湘电股份	6,200	31,992.00	0.11
689	600978	宜华生活	7,800	31,980.00	0.11
690	600751	海航科技	11,800	31,978.00	0.11
691	600026	中远海能	7,200	31,968.00	0.11
692	600507	方大特钢	3,200	31,968.00	0.11
693	002280	联络互动	8,256	31,950.72	0.11
694	600339	中油工程	8,800	31,944.00	0.11
695	600176	中国巨石	3,300	31,911.00	0.11
696	000066	中国长城	6,730	31,900.20	0.11
697	603233	大参林	800	31,888.00	0.11
698	603833	欧派家居	400	31,888.00	0.11
699	002517	恺英网络	8,592	31,876.32	0.11
700	002572	索菲亚	1,900	31,825.00	0.11
701	600335	国机汽车	5,100	31,824.00	0.11
702	002673	西部证券	4,149	31,822.83	0.11
703	600773	西藏城投	5,300	31,800.00	0.11
704	000860	顺鑫农业	997	31,794.33	0.11

705	002049	紫光国微	1,100	31,790.00	0.11
706	300182	捷成股份	7,407	31,776.03	0.11
707	002431	棕榈股份	8,900	31,773.00	0.11
708	002573	清新环境	4,400	31,768.00	0.11
709	000728	国元证券	4,544	31,717.12	0.11
710	300055	万邦达	4,134	31,707.78	0.11
711	000932	华菱钢铁	5,232	31,705.92	0.11
712	002176	江特电机	5,400	31,698.00	0.11
713	000786	北新建材	2,300	31,648.00	0.11
714	600410	华胜天成	5,400	31,644.00	0.11
715	000423	东阿阿胶	800	31,640.00	0.11
716	000062	深圳华强	1,899	31,637.34	0.11
717	300418	昆仑万维	2,457	31,597.02	0.11
718	601878	浙商证券	4,351	31,588.26	0.11
719	002456	欧菲科技	3,437	31,586.03	0.11
720	000587	金洲慈航	13,433	31,567.55	0.11
721	600809	山西汾酒	900	31,545.00	0.11
722	002353	杰瑞股份	2,100	31,500.00	0.11
723	603816	顾家家居	700	31,500.00	0.11
724	603160	汇顶科技	400	31,480.00	0.11
725	600582	天地科技	9,200	31,464.00	0.11
726	000961	中南建设	5,600	31,416.00	0.11
727	600536	中国软件	1,500	31,395.00	0.11
728	600759	洲际油气	13,300	31,388.00	0.11
729	002489	浙江永强	11,877	31,355.28	0.11
730	601611	中国核建	4,800	31,344.00	0.11
731	600240	华业资本	12,100	31,339.00	0.11
732	002745	木林森	2,775	31,329.75	0.11

733	601990	南京证券	3,600	31,320.00	0.11
734	600518	康美药业	3,400	31,314.00	0.11
735	600584	长电科技	3,800	31,312.00	0.11
736	300315	掌趣科技	8,862	31,282.86	0.11
737	300433	蓝思科技	4,800	31,248.00	0.11
738	000090	天健集团	6,784	31,206.40	0.11
739	002030	达安基因	3,069	31,181.04	0.11
740	002410	广联达	1,498	31,173.38	0.11
741	002354	天神娱乐	5,949	31,172.76	0.11
742	002466	天齐锂业	1,063	31,167.16	0.11
743	600393	粤泰股份	14,700	31,164.00	0.11
744	603986	兆易创新	500	31,160.00	0.11
745	002153	石基信息	1,200	31,152.00	0.11
746	000528	柳工	5,129	31,133.03	0.11
747	300088	长信科技	7,500	31,125.00	0.11
748	600499	科达洁能	7,700	31,108.00	0.11
749	600338	西藏珠峰	1,600	31,088.00	0.11
750	002271	东方雨虹	2,400	31,080.00	0.11
751	300266	兴源环境	8,800	31,064.00	0.11
752	300072	三聚环保	3,149	30,986.16	0.11
753	002308	威创股份	6,962	30,980.90	0.11
754	002366	台海核电	3,300	30,954.00	0.11
755	002027	分众传媒	5,900	30,916.00	0.11
756	300156	神雾环保	8,505	30,873.15	0.11
757	300324	旋极信息	5,500	30,855.00	0.11
758	300199	翰宇药业	3,300	30,822.00	0.11
759	600687	刚泰控股	7,400	30,710.00	0.11
760	002512	达华智能	5,777	30,675.87	0.11

761	002594	比亚迪	600	30,600.00	0.11
762	600816	安信信托	7,000	30,590.00	0.11
763	300287	飞利信	8,079	30,538.62	0.11
764	300070	碧水源	3,900	30,420.00	0.11
765	002709	天赐材料	1,400	30,324.00	0.11
766	600028	中国石化	6,000	30,300.00	0.11
767	002508	老板电器	1,500	30,285.00	0.11
768	000503	国新健康	1,900	30,172.00	0.11
769	603799	华友钴业	1,000	30,110.00	0.11
770	000792	盐湖股份	4,300	30,014.00	0.10
771	603259	药明康德	400	29,944.00	0.10
772	002310	东方园林	4,300	29,928.00	0.10
773	603650	彤程新材	1,500	29,745.00	0.10
774	300113	顺网科技	2,330	29,614.30	0.10
775	603444	吉比特	200	29,600.00	0.10
776	002437	誉衡药业	10,480	29,344.00	0.10
777	600122	宏图高科	8,000	29,040.00	0.10
778	002699	美盛文化	5,289	28,983.72	0.10
779	601066	中信建投	3,300	28,743.00	0.10
780	002555	三七互娱	3,000	28,320.00	0.10
781	002302	西部建设	3,200	28,288.00	0.10
782	600703	三安光电	2,500	28,275.00	0.10
783	600525	长园集团	6,100	26,718.00	0.09
784	300197	铁汉生态	7,000	26,530.00	0.09

### 8.3.2 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	600485	信威集团	2,726	27,341.78	0.10
2	000693	*ST 华泽	4,123	0.00	-

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601717	郑煤机	2,935,270.00	5.78
2	300251	光线传媒	2,639,087.00	5.20
3	600426	华鲁恒升	2,184,927.00	4.30
4	600038	中直股份	2,008,813.59	3.96
5	000598	兴蓉环境	1,958,552.00	3.86
6	000826	启迪桑德	1,866,341.00	3.68
7	600376	首开股份	1,772,370.00	3.49
8	600885	宏发股份	1,724,084.04	3.40
9	000786	北新建材	1,708,654.37	3.37
10	002251	步步高	1,623,887.55	3.20
11	600031	三一重工	1,560,979.00	3.08
12	000975	银泰资源	1,544,469.00	3.04
13	601633	长城汽车	1,535,508.00	3.03
14	600755	厦门国贸	1,535,091.00	3.02
15	600867	通化东宝	1,522,395.22	3.00
16	002242	九阳股份	1,509,473.00	2.97
17	600570	恒生电子	1,420,360.00	2.80
18	300199	翰宇药业	1,367,665.00	2.69
19	600519	贵州茅台	1,325,117.00	2.61

20	300039	上海凯宝	1,275,681.00	2.51
21	601318	中国平安	1,275,661.00	2.51
22	000536	华映科技	1,274,569.00	2.51
23	600516	方大炭素	1,256,180.97	2.47
24	601998	中信银行	1,251,438.00	2.47
25	601336	新华保险	1,243,917.00	2.45
26	000039	中集集团	1,240,752.00	2.44
27	601009	南京银行	1,235,106.00	2.43
28	600875	东方电气	1,207,019.00	2.38
29	002410	广联达	1,207,016.00	2.38
30	000727	华东科技	1,205,091.00	2.37
31	000997	新大陆	1,149,441.00	2.26
32	603025	大豪科技	1,114,827.15	2.20
33	600011	华能国际	1,114,547.37	2.20
34	601689	拓普集团	1,113,015.00	2.19
35	000776	广发证券	1,111,661.00	2.19
36	600737	中粮糖业	1,105,601.00	2.18
37	603883	老百姓	1,097,169.00	2.16
38	600808	马钢股份	1,089,480.00	2.15
39	002456	欧菲科技	1,067,124.00	2.10
40	600967	内蒙一机	1,066,310.00	2.10
41	600705	中航资本	1,059,346.00	2.09
42	000488	晨鸣纸业	1,052,078.00	2.07
43	600104	上汽集团	1,042,374.09	2.05

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。

#### 8.4.2 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	601717	郑煤机	2,880,620.00	5.68
2	300251	光线传媒	2,455,127.41	4.84
3	600038	中直股份	1,970,838.00	3.88
4	000598	兴蓉环境	1,860,784.59	3.67
5	000039	中集集团	1,815,357.95	3.58
6	600426	华鲁恒升	1,777,351.00	3.50
7	600376	首开股份	1,687,780.00	3.33
8	000826	启迪桑德	1,620,419.89	3.19
9	000786	北新建材	1,614,581.48	3.18
10	002242	九阳股份	1,567,081.98	3.09
11	603883	老百姓	1,554,945.00	3.06
12	600570	恒生电子	1,505,260.00	2.97
13	000536	华映科技	1,498,671.70	2.95
14	600031	三一重工	1,492,535.00	2.94
15	603025	大豪科技	1,482,534.58	2.92
16	600104	上汽集团	1,474,548.00	2.91
17	600885	宏发股份	1,445,540.45	2.85
18	601168	西部矿业	1,403,333.00	2.76
19	600755	厦门国贸	1,391,001.00	2.74
20	002251	步步高	1,341,369.29	2.64
21	300274	阳光电源	1,328,957.82	2.62
22	601009	南京银行	1,311,697.60	2.58
23	601318	中国平安	1,308,785.00	2.58
24	601633	长城汽车	1,296,842.00	2.56
25	002416	爱施德	1,286,000.94	2.53
26	600566	济川药业	1,282,344.00	2.53
27	600219	南山铝业	1,277,158.00	2.52

28	603369	今世缘	1,270,676.45	2.50
29	600201	生物股份	1,245,795.60	2.45
30	000513	丽珠集团	1,236,143.05	2.44
31	600867	通化东宝	1,234,267.00	2.43
32	300199	翰宇药业	1,225,687.34	2.41
33	600657	信达地产	1,217,720.00	2.40
34	002410	广联达	1,216,023.71	2.40
35	600183	生益科技	1,211,788.45	2.39
36	601336	新华保险	1,208,688.00	2.38
37	000997	新大陆	1,207,857.60	2.38
38	600875	东方电气	1,194,693.70	2.35
39	002078	太阳纸业	1,188,283.95	2.34
40	601998	中信银行	1,179,633.00	2.32
41	600859	王府井	1,174,388.70	2.31
42	600126	杭钢股份	1,172,259.60	2.31
43	002093	国脉科技	1,170,578.60	2.31
44	000975	银泰资源	1,165,721.92	2.30
45	600519	贵州茅台	1,155,413.00	2.28
46	300039	上海凯宝	1,133,703.00	2.23
47	000028	国药一致	1,124,934.20	2.22
48	600737	中粮糖业	1,105,012.00	2.18
49	600516	方大炭素	1,084,218.00	2.14
50	600011	华能国际	1,076,927.14	2.12
51	000727	华东科技	1,062,421.60	2.09
52	600705	中航资本	1,058,957.00	2.09
53	600030	中信证券	1,048,458.00	2.07
54	000776	广发证券	1,045,348.20	2.06
55	600967	内蒙一机	1,043,975.86	2.06



56	600260	凯乐科技	1,031,456.00	2.03
57	000960	锡业股份	1,026,799.52	2.02

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.3 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	213,891,219.34
卖出股票收入（成交）总额	223,602,835.98

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券包括中信银行（证券代码：601998）。

根据中国银监会于 2018 年 11 月 19 日发布的行政处罚信息公开表（银监罚决字（2018）14 号），该公司理财资金违规缴纳土地款、自有资金融资违规缴纳土地款等多种行为，已由中国银行业监督管理委员会调查完毕并依法对中信银行股份有限公司做出行政处罚。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	5,327.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	531.03
5	应收申购款	515.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,374.23

### 8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 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。

**8.12.5.2 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	600485	信威集团	27,341.78	0.10	重大事项
2	000693	*ST 华泽	0.00	-	重大事项

**8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	71	27,045.59	920,053.00	47.91%	1,000,184.00	52.09%
中证 800B	499	3,848.17	3,601.00	0.19%	1,916,636.00	99.81%
800 分级	1,353	29,580.76	23,659,928.79	59.12%	16,362,844.98	40.88%
合计	1,923	22,809.80	24,583,582.79	56.05%	19,279,664.98	43.95%

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。

### 9.2 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	47.91%
2	李怡名	564,841.00	29.42%
3	吕谷城	96,000.00	5.00%
4	郑龙根	90,572.00	4.72%
5	郑志坤	78,156.00	4.07%
6	孙林红	73,079.00	3.81%
7	黄晖	25,125.00	1.31%
8	张志贇	14,869.00	0.77%
9	胡葛芳	11,392.00	0.59%
10	林香文	10,400.00	0.54%

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	180,870.00	9.42%
2	吴保刚	144,703.00	7.54%
3	李明华	102,017.00	5.31%
4	王玉印	94,940.00	4.94%
5	钱中明	69,500.00	3.62%
6	查刚	60,419.00	3.15%
7	李芳华	57,400.00	2.99%
8	王亚峰	56,801.00	2.96%
9	乔兴舫	49,200.00	2.56%
10	李英慧	40,000.00	2.08%

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。

### 9.3 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	0.00	0.00%
	中证 800B	0.00	0.00%
	800 分级	165,071.75	0.41%
	合计	165,071.75	0.38%

### 9.4 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。

## § 10 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	1,861,621.00	1,861,621.00	48,325,298.15
本报告期期间基金总申购份额	-	-	3,655,844.80
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	13,340,203.13
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	58,616.00	58,616.00	1,381,833.95
本报告期末基金份额总额	1,920,237.00	1,920,237.00	40,022,773.77

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中的调整份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 6 月 23 日发布关于副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，苏薪茗先生自 2018 年 6 月 21 日起担任本基金管理人副总经理职务。

#### 11.2.2 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，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已为本基金连续提供了 5 年的审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
方正证券股 份有限公司	4	437,494,055.32	100.00%	13,694.36	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	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
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	3	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
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	-	-	-	-	新增 2 个 交易单元
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	0	-	-	-	-	撤销 2 个 交易单元
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	-	-	-	-	-
民生证券股	2	-	-	-	-	新增 2 个

份有限公司						交易单元
山西证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中天证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易单元
太平洋证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元

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

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证	-	-	-	-	-	-

券有限责任 公司						
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

国元证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国中投证	-	-	-	-	-	-

券有限责任 公司						
中天证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-

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。

### 11.8 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 2017 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	2018 年 1 月 2 日
2	《银华基金管理股份有限公司关于证券投资基金执行增值税政策的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2018 年 1 月 3 日
3	《关于网上直销开通中国建设银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2018 年 1 月 3 日
4	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2018 年 1 月 19 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金持有的 *ST 华泽估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2018 年 2 月 3 日
6	《银华基金管理股份有限公司	三大证券报及本基	2018 年 2 月 7 日

	司关于旗下基金持有的 *ST 华泽估值方法调整的公 告》	金管理人网站	
7	《银华基金管理股份有限公 司关于旗下部分基金参加北 京恒天明泽基金销售有限公 司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 9 日
8	《银华基金管理股份有限公 司关于调整旗下部分公开募 集开放式证券投资基金赎回 费的提示性公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 27 日
9	《银华基金管理股份有限公 司关于修订公司旗下部分基 金基金合同有关条款及调整 赎回费的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
10	《银华中证 800 等权重指数 增强分级证券投资基金托管 协议（2018 年 3 月修订）》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
11	《银华中证 800 等权重指数 增强分级证券投资基金基金 合同（2018 年 3 月修订）》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
12	《银华基金管理股份有限公 司关于在交通银行参加手机 银行渠道费率优惠活动的公 告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
13	《银华中证 800 等权重指数 增强分级证券投资基金 2017 年年度报告摘要》	三大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
14	《银华中证 800 等权重指数	本基金管理人网站	2018 年 3 月 30 日



	增强分级证券投资基金 2017 年年度报告》		
15	《银华中证 800 等权重指数 增强分级证券投资基金 2018 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 4 月 23 日
16	《银华基金管理股份有限公 司关于旗下部分基金参加中 国国际金融股份有限公司费 率优惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 4 月 24 日
17	《银华基金管理股份有限公 司关于旗下部分基金参加东 海证券股份有限公司费率优 惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 4 月 24 日
18	《关于网上直销开通中国农 业银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 5 月 3 日
19	《银华基金管理股份有限公 司关于旗下部分基金在浙江 同花顺基金销售有限公司参 加其申购、定期定额投资业 务费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 5 月 12 日
20	《关于旗下部分基金在中国 银河证券股份有限公司开通 定期定额投资业务并参加费 率优惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 5 月 18 日
21	《银华基金管理股份有限公 司关于调整旗下部分基金定 期定额投资的最低金额的公 告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 6 月 11 日

22	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司定期定额投资业务起点的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 13 日
23	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 15 日
24	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2018 年 6 月 15 日
25	《银华基金管理股份有限公司关于暂停及恢复网上交易相关业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
26	《银华基金管理股份有限公司关于开通超级生利宝赎回转购业务并实施费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
27	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金暂停场内申购（含定期定额投资）及跨系统转托管（仅限场外转场内）业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 28 日
28	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 30 日
29	《银华基金管理股份有限公司	四大证券报及本基	2018 年 7 月 2 日

	司 2018 年 6 月 30 日基金净值公告》	金管理人网站	
30	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在中泰证券股份有限公司定期定额投资业务起点的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 16 日
31	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金持有的*ST 华泽估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 18 日
32	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2018 年第 2 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 19 日
33	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的首航节能估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 8 月 17 日
34	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2018 年半年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 8 月 28 日
35	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2018 年半年度报告》	本基金管理人网站	2018 年 8 月 28 日
36	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 9 月 29 日
37	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 12 日

	经纬纺机、长信科技估值方法调整的公告》		
38	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 12 日
39	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 12 日
40	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 16 日
41	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 16 日
42	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 19 日
43	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 19 日
44	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 23 日

45	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 23 日
46	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2018 年第 3 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 24 日
47	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 26 日
48	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 26 日
49	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 30 日
50	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 10 月 30 日
51	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 2 日
52	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 11 月 2 日

53	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 8 日
54	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 11 月 8 日
55	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 24 日
56	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 11 月 24 日
57	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 27 日
58	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 11 月 27 日
59	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停赎回、跨系统转托管及场外申购（含定期定额投资）业务及恢复申购、赎回、跨	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 28 日

	系统转托管业务及定期定额投资业务的公告》		
60	《关于银华中证 800 指数增强分级证券投资基金办理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	2018 年 11 月 28 日
61	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 11 月 30 日
62	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 11 月 30 日
63	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 4 日
64	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间中证 800A 份额停复牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 4 日
65	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金定期份额折算前收盘价调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 5 日
66	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 5 日

	定期份额折算结果及恢复交易的公告》		
67	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 7 日
68	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 7 日
69	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 11 日
70	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 11 日
71	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 14 日
72	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 14 日
73	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 17 日



	2 号)》		
74	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书(2018 年第 2 号)》	本基金管理人网站	2018 年 12 月 17 日
75	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 18 日
76	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 18 日
77	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 21 日
78	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 21 日
79	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 25 日
80	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 25 日
81	《银华中证 800 等权重指数	三大证券报及本基	2018 年 12 月 26 日

	增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	金管理人网站	
82	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 26 日
83	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 27 日
84	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 27 日
85	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 28 日
86	《关于银华中证 800 等权重指数增强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	2018 年 12 月 28 日
87	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之中证 800B 交易价格波动提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 29 日
88	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 29 日

	风险提示公告》		
--	---------	--	--

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2018/01/01-2018/12/31	22,735,065.19	810,653.60	0.00	23,545,718.79	53.68%

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2018 年 3 月 28 日披露了《关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款及调整赎回费的公告》，修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于 2018 年 4 月 1 日起正式实施。

2、本基金管理人于 2018 年 6 月 11 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》，自 2018 年 6 月 12 日起调整本基金定期定额投资

的最低金额为 10 元。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 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住所。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。

### 13.3 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。

银华基金管理股份有限公司

2019 年 3 月 28 日