

银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 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。本中期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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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.....	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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§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.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	60
§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	113,174,692.01 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	14,667,902.00 份	14,667,902.00 份	83,838,888.01 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%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为复制指数的股票型基金，其风险和预期收益高于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	李申
	联系电话	(010)58163000	021-60637102
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	021-60637111
传真		(010)58163027	021-60635778
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
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王珠林	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	7,953,566.17
本期利润	6,318,375.64
加权平均基金份额本期利润	0.0359
本期加权平均净值利润率	3.61%
本期基金份额净值增长率	5.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	28,399,213.23
期末可供分配基金份额利润	0.2509
期末基金资产净值	120,187,973.79
期末基金份额净值	1.062
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	88.11%

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	7.93%	0.84%	7.29%	0.85%	0.64%	-0.01%
过去三个月	13.22%	0.84%	12.29%	0.85%	0.93%	-0.01%
过去六个月	5.67%	1.42%	1.64%	1.45%	4.03%	-0.03%
过去一年	17.97%	1.13%	8.50%	1.16%	9.47%	-0.03%
过去三年	26.23%	1.19%	13.21%	1.19%	13.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	88.11%	1.42%	82.08%	1.42%	6.03%	0.00%

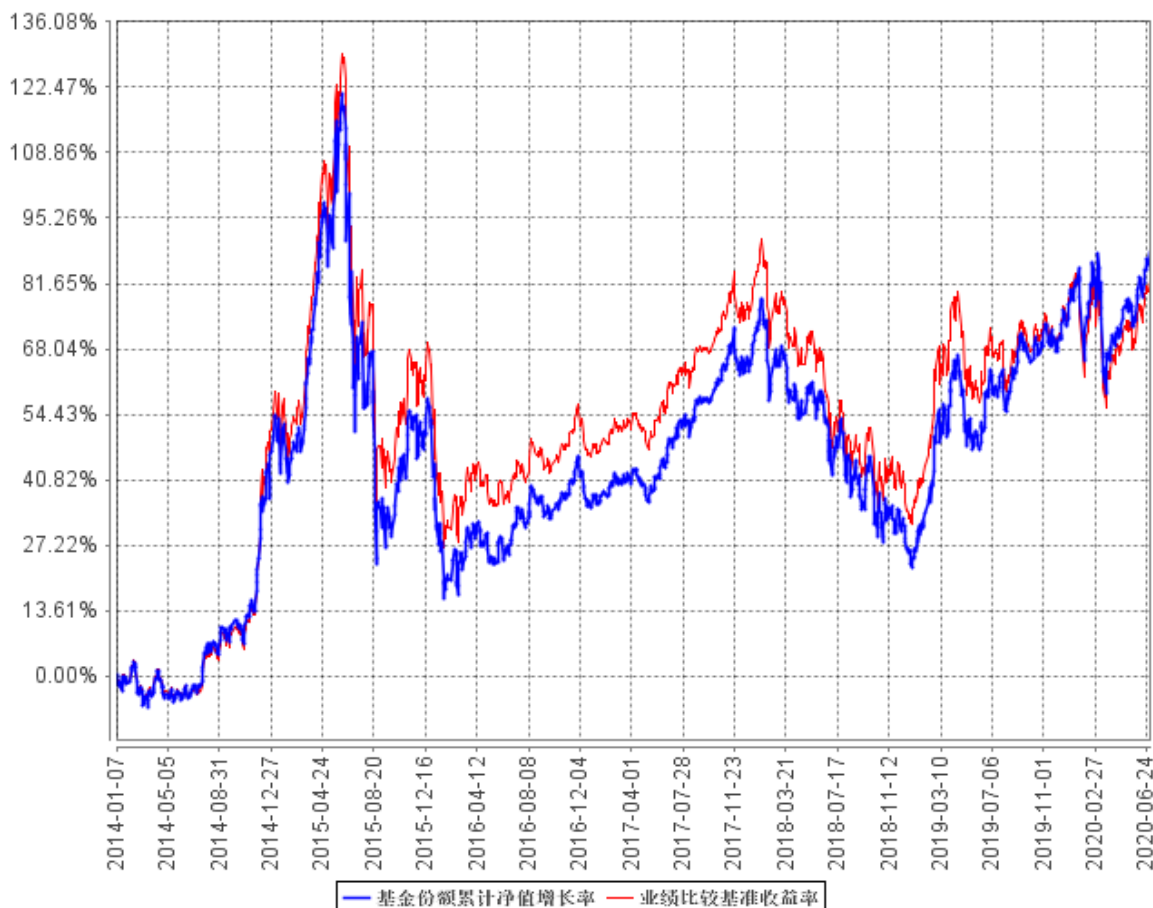
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

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 $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 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



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%–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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 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%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 130 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-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、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、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、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、银华信息科技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、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华安享短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券

投资基金 (QDII)、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金。同时, 本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2018 年 3 月 7 日	-	10.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司, 曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务, 自 2012 年 11 月 14 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理, 自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 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日至2018年11月30日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，自2019年6月28日起兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年8月29日起兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2019年12月6日起兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2020年1月10日	-	8.5年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012年8月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2020年4月13日	-	7.5年	硕士学位，曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司，2015年加入银华基金，历任量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《公开募集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参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们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。除此之外运用自行开发的量化投资模型精选个股，力争实现超越基准的阿尔法收益。

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 1.062 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.67%，业绩比较基准收益率为 1.64%。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

2020 年上半年中，新冠疫情的扩散改变了全球经济、市场的原有格局。国内方面，通过完善的联防联控与严格的检测治疗措施，已经使疫情得到了有效的控制，二季度中已经进入有序复工复产，主要经济数据也已经显著反弹。而国外方面，疫情仍然在大规模的扩散过程中。在国内疫情控制与经济恢复的背景下，A 股市场在经历了一季度震荡之后，形成了一轮结构性反弹行情，创业板、中小板领涨主要指数。行业层面，医药、餐饮旅游、食品饮料等行业表现领先，石油石化、煤炭、银行等行业表现落后。

展望下半年我们认为，疫情的发展与控制仍将是全球市场的核心变量，也将反过来影响 A 股市场的情绪与资金流向。目前，在国内疫情控制得力的背景下，下半年复工复产进程可期，A 股市场也将持续出现机会。我们需要关注的风险点在于，全球疫情的扩散带来的国际摩擦等黑天鹅事件。在此过程中，我们持续看好龙头类公司的超额收益。

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,805,706.47	15,006,992.40
结算备付金		392,538.68	845,956.70
存出保证金		35,956.59	37,098.41
交易性金融资产	6.4.7.2	111,229,476.24	192,157,124.42
其中：股票投资		111,229,476.24	192,157,124.42
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	2,192.00	3,642.65
应收股利		-	-
应收申购款		20,619.28	108,504.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		121,486,489.26	208,159,319.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	1,063.25
应付赎回款		699,949.57	1,144,150.86
应付管理人报酬		105,776.34	171,132.77
应付托管费		23,270.81	37,649.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	301,671.31	507,626.82
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	167,847.44	220,206.48
负债合计		1,298,515.47	2,081,829.39
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	91,788,760.56	166,348,986.47
未分配利润	6.4.7.10	28,399,213.23	39,728,503.32
所有者权益合计		120,187,973.79	206,077,489.79
负债和所有者权益总计		121,486,489.26	208,159,319.18

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，300 分级份额净值为人民币 1.062 元，银华 300A 份额净值为人民币 1.029 元，银华 300B 份额净值为人民币 1.095 元；基金份额总额为 113,174,692.01 份，其中 300 分级份额为 83,838,888.01 份，银华 300A 份额为 14,667,902.00 份，银华 300B 份额为 14,667,902.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		8,822,486.57	31,405,708.24
1.利息收入		59,839.27	37,220.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,839.27	37,220.71
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,279,022.69	13,121,346.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,983,172.70	11,812,144.56
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	1,295,849.99	1,309,202.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,635,190.53	18,150,400.10
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	118,815.14	96,740.68
减：二、费用		2,504,110.93	1,751,561.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	871,985.29	601,889.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	191,836.80	132,415.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,226,139.03	780,175.00
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	6.4.7.20	214,149.81	237,081.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,318,375.64	29,654,146.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,318,375.64	29,654,146.25

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	166,348,986.47	39,728,503.32	206,077,489.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,318,375.64	6,318,375.64
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）	-74,560,225.91	-17,647,665.73	-92,207,891.64
其中：1.基金申购款	11,568,864.47	2,555,224.04	14,124,088.51
2.基金赎回款	-86,129,090.38	-20,202,889.77	-106,331,980.15
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）	91,788,760.56	28,399,213.23	120,187,973.79
	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
项目	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）	125,543,057.38	-15,411,120.32	110,131,937.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,654,146.25	29,654,146.25
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）	-16,654,677.69	-2,274,664.40	-18,929,342.09
其中：1.基金申购款	18,731,082.29	-72,171.74	18,658,910.55
2.基金赎回款	-35,385,759.98	-2,202,492.66	-37,588,252.64
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）	108,888,379.69	11,968,361.53	120,856,741.22

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
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

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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准选定为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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。

6.4.5 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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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。

6.4.6.2 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。

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[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[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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	9,805,706.47
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：	9,805,706.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	103,913,522.60	111,229,476.24	7,315,953.64
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	103,913,522.60	111,229,476.24	7,315,953.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,996.37
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	176.60
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	2.83
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	16.20
合计	2,192.00

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	301,671.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	301,671.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,999.69
应付证券出借违约金	-
其他	3,963.25
预提费用	111,884.50
指数使用费	50,000.00
合计	167,847.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,103,047.81	166,348,986.47
本期申购	14,264,600.33	11,568,864.47
本期赎回(以“-”号填列)	-106,192,956.13	-86,129,090.38
- 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	113,174,692.01	91,788,760.56

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	65,553,715.07	-25,825,211.75	39,728,503.32
本期利润	7,953,566.17	-1,635,190.53	6,318,375.64
本期基金份额交易产生的变动数	-31,649,872.60	14,002,206.87	-17,647,665.73
其中：基金申购款	5,035,038.41	-2,479,814.37	2,555,224.04

基金赎回款	-36,684,911.01	16,482,021.24	-20,202,889.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,857,408.64	-13,458,195.41	28,399,213.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	54,470.99
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	5,087.73
其他	280.55
合计	59,839.27

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	477,222,334.73
减：卖出股票成本总额	468,239,162.03
买卖股票差价收入	8,983,172.70

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,295,849.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,295,849.99

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,635,190.53
——股票投资	-1,635,190.53
——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	-1,635,190.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	118,815.14
合计	118,815.14

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,226,139.03
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	1,226,139.03

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,265.31
指数使用费	100,000.00
上市费	29,835.26
合计	214,149.81

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
西南证券	93,372,481.67	10.90%	15,614,270.55	3.03%
第一创业	106,350,678.07	12.42%	17,896,114.42	3.47%
东北证券	-	-	61,613,317.87	11.95%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

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 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西南证券	86,958.00	13.17%	86,958.00	28.83%
第一创业	99,043.89	15.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
西南证券	14,541.65	3.12%	-	-
第一创业	16,666.75	3.58%	16,666.75	8.34%
东北证券	57,380.52	12.32%	57,380.52	28.73%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	871,985.29	601,889.75
其中：支付销售机构的客户维护费	91,935.68	92,223.73

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	191,836.80	132,415.71

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	9,805,706.47	54,470.99	9,835,143.38	33,755.79

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

无。

6.4.12 期末（2020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
601816	京沪高铁	2020年1月8日	2020年7月	新发流通	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-

		日	月 16	受限						
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	11.33	11.33	5,679	64,343.07	64,343.07	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	15.50	15.50	3,281	50,855.50	50,855.50	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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。

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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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约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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	9,805,706.47	-	-	-	-	-	9,805,706.47
结算备付金	392,538.68	-	-	-	-	-	392,538.68
存出保证金	35,956.59	-	-	-	-	-	35,956.59
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	111,229,476.24	111,229,476.24
应收利息	-	-	-	-	-	2,192.00	2,192.00
应收申购款	10.00	-	-	-	-	20,609.28	20,619.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,234,211.74	-	-	-	-	111,252,277.52	121,486,489.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	699,949.57	699,949.57
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	105,776.34	105,776.34
应付托管费	-	-	-	-	-	23,270.81	23,270.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	301,671.31	301,671.31
其他负债	-	-	-	-	-	167,847.44	167,847.44
负债总计	-	-	-	-	-	1,298,515.47	1,298,515.47
利率敏感度缺 口	10,234,211.74	-	-	-	-	-109,953,762.05	120,187,973.79
上年度末 2019年12月	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

31 日							
资产							
银行存款	15,006,992.40	-	-	-	-	-	15,006,992.40
结算备付金	845,956.70	-	-	-	-	-	845,956.70
存出保证金	37,098.41	-	-	-	-	-	37,098.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-192,157,124.42	192,157,124.42
应收利息	-	-	-	-	-	3,642.65	3,642.65
应收申购款	497.02	-	-	-	-	108,007.58	108,504.60
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,890,544.53	-	-	-	-	-192,268,774.65	208,159,319.18
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,063.25	1,063.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,144,150.86	1,144,150.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,132.77	171,132.77
应付托管费	-	-	-	-	-	37,649.21	37,649.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	507,626.82	507,626.82
其他负债	-	-	-	-	-	220,206.48	220,206.48
负债总计	-	-	-	-	-	2,081,829.39	2,081,829.39
利率敏感度缺口	15,890,544.53	-	-	-	-	-190,186,945.26	206,077,489.79

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。

6.4.13.4.1.2 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。

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。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	111,229,476.24	92.55	192,157,124.42	93.25
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	111,229,476.24	92.55	192,157,124.42	93.25

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。		
	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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	5,765,657.85	9,831,857.31
	业绩比较基准下降 5%	-5,765,657.85	-9,831,857.31

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	111,229,476.24	91.56
	其中：股票	111,229,476.24	91.56
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	10,198,245.15	8.39
8	其他各项资产	58,767.87	0.05
9	合计	121,486,489.26	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	1,633,409.80	1.36
B	采矿业	2,803,608.29	2.33
C	制造业	46,720,003.30	38.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,979,600.22	1.65
E	建筑业	2,681,068.97	2.23
F	批发和零售业	892,487.96	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	8,520,738.17	7.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,375,257.78	4.47
J	金融业	30,662,334.53	25.51
K	房地产业	3,476,632.14	2.89
L	租赁和商务服务业	612,423.28	0.51
M	科学研究和技术服务业	3,723,253.80	3.10
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	123,487.50	0.10
Q	卫生和社会工作	46,491.50	0.04
R	文化、体育和娱乐业	557,457.90	0.46
S	综合	-	-
	合计	109,808,255.14	91.36

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	1,260,018.08	1.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	37,728.00	0.03
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	8,286.10	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	102,422.60	0.09
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	1,421,221.10	1.18

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港股通投资股票。

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	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	4.65
2	000858	五粮液	22,727	3,889,044.24	3.24
3	601318	中国平安	53,355	3,809,547.00	3.17
4	603259	药明康德	38,543	3,723,253.80	3.10
5	600519	贵州茅台	2,522	3,689,383.36	3.07
6	601688	华泰证券	192,406	3,617,232.80	3.01
7	000333	美的集团	56,937	3,404,263.23	2.83
8	000001	平安银行	220,328	2,820,198.40	2.35
9	600036	招商银行	76,646	2,584,503.12	2.15
10	002555	三七互娱	49,087	2,297,271.60	1.91
11	600867	通化东宝	125,905	2,194,524.15	1.83
12	002142	宁波银行	83,172	2,184,928.44	1.82
13	601601	中国太保	70,897	1,931,943.25	1.61
14	601658	邮储银行	400,000	1,828,000.00	1.52
15	300124	汇川技术	43,896	1,667,609.04	1.39
16	000661	长春高新	3,684	1,603,645.20	1.33
17	600570	恒生电子	14,833	1,597,514.10	1.33
18	600048	保利地产	102,337	1,512,540.86	1.26
19	000895	双汇发展	31,665	1,459,439.85	1.21
20	300059	东方财富	64,348	1,299,829.60	1.08
21	601390	中国中铁	255,065	1,280,426.30	1.07
22	600887	伊利股份	40,823	1,270,819.99	1.06
23	600309	万华化学	24,689	1,234,203.11	1.03
24	601899	紫金矿业	272,121	1,197,332.40	1.00
25	601166	兴业银行	70,363	1,110,328.14	0.92
26	000651	格力电器	16,987	960,954.59	0.80
27	600011	华能国际	226,794	957,070.68	0.80
28	002475	立讯精密	18,563	953,210.05	0.79
29	300136	信维通信	17,703	938,613.06	0.78
30	601012	隆基股份	22,985	936,179.05	0.78
31	603501	韦尔股份	4,556	920,084.20	0.77
32	603288	海天味业	7,308	909,115.20	0.76
33	600585	海螺水泥	17,099	904,708.09	0.75

34	600958	东方证券	93,308	885,492.92	0.74
35	000063	中兴通讯	21,384	858,139.92	0.71
36	300498	温氏股份	39,321	857,197.80	0.71
37	000625	长安汽车	75,150	826,650.00	0.69
38	600009	上海机场	11,215	808,265.05	0.67
39	601186	中国铁建	93,567	784,091.46	0.65
40	002714	牧原股份	9,466	776,212.00	0.65
41	601009	南京银行	105,624	774,223.92	0.64
42	601919	中远海控	221,862	769,861.14	0.64
43	000157	中联重科	117,813	757,537.59	0.63
44	600030	中信证券	31,042	748,422.62	0.62
45	002007	华兰生物	14,766	739,924.26	0.62
46	603160	汇顶科技	3,217	717,069.30	0.60
47	600438	通威股份	40,767	708,530.46	0.59
48	601818	光大银行	196,053	701,869.74	0.58
49	000977	浪潮信息	17,900	701,322.00	0.58
50	300122	智飞生物	6,894	690,434.10	0.57
51	600926	杭州银行	74,492	664,468.64	0.55
52	601888	中国中免	3,976	612,423.28	0.51
53	601211	国泰君安	35,300	609,278.00	0.51
54	601021	春秋航空	16,679	587,767.96	0.49
55	603019	中科曙光	14,995	575,808.00	0.48
56	600109	国金证券	50,100	571,641.00	0.48
57	002916	深南电路	3,395	568,730.40	0.47
58	300144	宋城演艺	32,223	557,457.90	0.46
59	000002	万科 A	21,252	555,527.28	0.46
60	601628	中国人寿	19,806	538,921.26	0.45
61	600809	山西汾酒	3,713	538,385.00	0.45
62	601328	交通银行	103,591	531,421.83	0.44
63	600031	三一重工	27,335	512,804.60	0.43
64	600050	中国联通	105,600	511,104.00	0.43
65	600900	长江电力	26,890	509,296.60	0.42
66	300408	三环集团	18,090	501,093.00	0.42
67	601336	新华保险	11,193	495,626.04	0.41
68	002311	海大集团	10,404	495,126.36	0.41
69	600297	广汇汽车	151,606	483,623.14	0.40
70	600104	上汽集团	27,595	468,839.05	0.39
71	000568	泸州老窖	5,081	462,980.72	0.39
72	601857	中国石油	107,112	448,799.28	0.37

73	601998	中信银行	86,268	444,280.20	0.37
74	600118	中国卫星	14,189	437,446.87	0.36
75	601100	恒立液压	5,300	425,060.00	0.35
76	600346	恒力石化	30,259	423,626.00	0.35
77	601933	永辉超市	43,589	408,864.82	0.34
78	600362	江西铜业	29,866	401,996.36	0.33
79	600383	金地集团	29,094	398,587.80	0.33
80	600999	招商证券	18,096	397,207.20	0.33
81	600741	华域汽车	19,073	396,527.67	0.33
82	300433	蓝思科技	14,023	393,204.92	0.33
83	002410	广联达	5,639	393,038.30	0.33
84	000100	TCL 科技	62,157	385,373.40	0.32
85	000338	潍柴动力	27,752	380,757.44	0.32
86	600038	中直股份	9,255	380,102.85	0.32
87	002146	荣盛发展	45,907	371,846.70	0.31
88	002415	海康威视	12,218	370,816.30	0.31
89	600276	恒瑞医药	3,928	362,554.40	0.30
90	601111	中国国航	52,640	347,950.40	0.29
91	601838	成都银行	43,527	346,474.92	0.29
92	601668	中国建筑	72,281	344,780.37	0.29
93	002371	北方华创	2,000	341,820.00	0.28
94	000671	阳光城	53,694	340,419.96	0.28
95	000876	新希望	10,300	306,940.00	0.26
96	603993	洛阳钼业	82,607	303,167.69	0.25
97	600703	三安光电	11,965	299,125.00	0.25
98	000938	紫光股份	6,810	292,693.80	0.24
99	600837	海通证券	22,568	283,905.44	0.24
100	600015	华夏银行	44,836	274,396.32	0.23
101	002773	康弘药业	5,483	271,956.80	0.23
102	601800	中国交建	37,026	271,770.84	0.23
103	002508	老板电器	8,270	257,279.70	0.21
104	002001	新和成	8,483	246,855.30	0.21
105	600176	中国巨石	26,207	239,794.05	0.20
106	603986	兆易创新	969	228,596.79	0.19
107	002460	赣锋锂业	4,187	224,297.59	0.19
108	600674	川投能源	23,917	221,710.59	0.18
109	600989	宝丰能源	25,330	213,278.60	0.18
110	601398	工商银行	42,558	211,938.84	0.18
111	002352	顺丰控股	3,831	209,555.70	0.17

112	002120	韵达股份	8,344	204,010.80	0.17
113	601088	中国神华	13,765	197,665.40	0.16
114	002153	石基信息	5,043	196,828.29	0.16
115	601898	中煤能源	51,755	196,669.00	0.16
116	000725	京东方 A	41,169	192,259.23	0.16
117	000627	天茂集团	36,824	191,853.04	0.16
118	600886	国投电力	24,285	190,880.10	0.16
119	600188	兖州煤业	21,778	190,775.28	0.16
120	600588	用友网络	4,241	187,028.10	0.16
121	601766	中国中车	32,564	181,381.48	0.15
122	000786	北新建材	8,437	179,961.21	0.15
123	000708	中信特钢	10,300	176,027.00	0.15
124	000776	广发证券	11,829	167,025.48	0.14
125	600016	民生银行	29,263	165,921.21	0.14
126	002271	东方雨虹	4,004	162,682.52	0.14
127	002493	荣盛石化	12,076	148,534.80	0.12
128	601600	中国铝业	52,766	145,634.16	0.12
129	300003	乐普医疗	3,689	134,722.28	0.11
130	601138	工业富联	8,844	133,986.60	0.11
131	600690	海尔智家	7,452	131,900.40	0.11
132	002607	中公教育	4,450	123,487.50	0.10
133	002129	中环股份	5,400	121,284.00	0.10
134	601225	陕西煤业	16,686	120,306.06	0.10
135	600019	宝钢股份	25,768	117,502.08	0.10
136	000961	中南建设	12,143	108,072.70	0.09
137	600177	雅戈尔	17,338	103,334.48	0.09
138	002945	华林证券	7,156	98,824.36	0.08
139	601808	中海油服	7,457	97,984.98	0.08
140	601997	贵阳银行	13,455	96,337.80	0.08
141	601288	农业银行	28,010	94,673.80	0.08
142	600406	国电南瑞	4,575	92,643.75	0.08
143	600340	华夏幸福	3,941	90,091.26	0.07
144	600183	生益科技	3,050	89,273.50	0.07
145	600928	西安银行	14,614	76,869.64	0.06
146	600919	江苏银行	12,996	73,687.32	0.06
147	600795	国电电力	39,307	72,717.95	0.06
148	600271	航天信息	4,434	72,008.16	0.06
149	300033	同花顺	505	67,205.40	0.06
150	600606	绿地控股	10,739	66,367.02	0.06

151	002202	金风科技	5,609	55,921.73	0.05
152	000723	美锦能源	8,541	53,466.66	0.04
153	600028	中国石化	13,020	50,908.20	0.04
154	002241	歌尔股份	1,600	46,976.00	0.04
155	300015	爱尔眼科	1,070	46,491.50	0.04
156	002304	洋河股份	400	42,056.00	0.03
157	603899	晨光文具	620	33,852.00	0.03
158	000656	金科股份	4,066	33,178.56	0.03
159	002624	完美世界	566	32,624.24	0.03
160	600705	中航资本	7,844	31,062.24	0.03
161	002050	三花智控	1,400	30,660.00	0.03
162	600027	华电国际	8,165	27,924.30	0.02
163	300628	亿联网络	400	27,304.00	0.02

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	000898	鞍钢股份	263,199	644,837.55	0.54
2	688123	聚辰股份	4,440	341,880.00	0.28
3	000415	渤海租赁	34,370	102,422.60	0.09
4	688528	秦川物联	5,679	64,343.07	0.05
5	688600	皖仪科技	3,281	50,855.50	0.04
6	600566	济川药业	1,923	48,959.58	0.04
7	603087	甘李药业	452	45,335.60	0.04
8	002081	金螳螂	4,800	37,728.00	0.03
9	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
13	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
14	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	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	000661	长春高新	10,063,881.00	4.88
2	601688	华泰证券	8,111,360.00	3.94
3	601211	国泰君安	7,876,276.00	3.82
4	603259	药明康德	7,461,933.60	3.62
5	000858	五粮液	7,004,890.83	3.40
6	601601	中国太保	6,775,733.00	3.29
7	000333	美的集团	6,419,445.00	3.12
8	601318	中国平安	6,392,364.12	3.10
9	601816	京沪高铁	6,319,848.88	3.07
10	000001	平安银行	6,178,653.31	3.00
11	002555	三七互娱	6,160,647.00	2.99
12	002007	华兰生物	6,126,603.14	2.97
13	600036	招商银行	5,805,010.00	2.82
14	601328	交通银行	5,634,409.00	2.73
15	600519	贵州茅台	5,159,126.75	2.50
16	000651	格力电器	5,127,514.98	2.49
17	600011	华能国际	5,093,840.00	2.47
18	603160	汇顶科技	4,798,029.25	2.33
19	002475	立讯精密	4,618,779.00	2.24
20	601166	兴业银行	4,400,560.00	2.14
21	601899	紫金矿业	4,225,662.15	2.05
22	600362	江西铜业	4,196,575.96	2.04

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	000858	五粮液	16,760,065.02	8.13
2	000661	长春高新	13,259,182.12	6.43
3	601318	中国平安	11,116,230.17	5.39
4	601688	华泰证券	10,866,326.50	5.27
5	603160	汇顶科技	9,936,493.27	4.82
6	000333	美的集团	9,560,780.63	4.64
7	601398	工商银行	8,854,908.23	4.30

8	002007	华兰生物	8,116,134.48	3.94
9	601166	兴业银行	8,001,206.59	3.88
10	601211	国泰君安	7,703,587.89	3.74
11	600519	贵州茅台	7,349,411.26	3.57
12	000651	格力电器	7,345,590.02	3.56
13	300498	温氏股份	7,175,956.27	3.48
14	000002	万科 A	6,525,987.88	3.17
15	600104	上汽集团	6,441,760.28	3.13
16	600276	恒瑞医药	6,369,447.80	3.09
17	600390	五矿资本	6,120,018.02	2.97
18	601818	光大银行	5,822,050.55	2.83
19	601601	中国太保	5,581,907.12	2.71
20	601336	新华保险	5,576,161.78	2.71
21	300033	同花顺	5,493,430.32	2.67
22	002555	三七互娱	5,378,161.55	2.61
23	603259	药明康德	5,347,224.07	2.59
24	601998	中信银行	5,344,746.58	2.59
25	002202	金风科技	5,235,531.52	2.54
26	002475	立讯精密	5,158,646.04	2.50
27	601328	交通银行	5,085,284.75	2.47
28	603288	海天味业	4,947,170.30	2.40
29	002415	海康威视	4,746,860.43	2.30
30	600011	华能国际	4,485,873.02	2.18
31	600036	招商银行	4,308,830.55	2.09
32	601169	北京银行	4,214,941.55	2.05

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	388,946,704.38
卖出股票收入（成交）总额	477,222,334.73

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

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

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

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

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

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

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

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受到调查以及处罚的情况的说明**

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	35,956.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,192.00
5	应收申购款	20,619.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,767.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	5,593,327.12	4.65	新发流通受限

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	688528	秦川物联	64,343.07	0.05	新股流通受限
2	688600	皖仪科技	50,855.50	0.04	新股流通受限

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	197	74,456.36	8,796,928.00	59.97%	5,870,974.00	40.03%
银华 300B	538	27,263.76	-	0.00%	14,667,902.00	100.00%
300 分级	16,595	5,052.06	6,759,524.22	8.06%	77,079,363.79	91.94%
合计	17,330	6,530.57	15,556,452.22	13.75%	97,618,239.79	86.25%

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	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅十四号证券投资私募基金	2,220,057.00	15.14%
2	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	2,000,623.00	13.64%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	1,271,811.00	8.67%
4	海通资管—上海银行—海通赢家系列—月月赢集合资产管理计划	1,060,691.00	7.23%
5	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅六号证券投资私募基金	995,000.00	6.78%
6	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅十三号证券投资私募基金	943,694.00	6.43%
7	杨镓源	825,000.00	5.62%
8	唐红	670,743.00	4.57%
9	杨宪震	435,000.00	2.97%
10	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	2.81%

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	17.04%

2	李祖平	1,440,891.00	9.82%
3	覃贵良	1,072,500.00	7.31%
4	陈淑芬	628,492.00	4.28%
5	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	581,400.00	3.96%
6	娄湖山	451,565.00	3.08%
7	尉睦金	306,707.00	2.09%
8	符安民	306,661.00	2.09%
9	王爽	273,300.00	1.86%
10	迟振才	254,100.00	1.73%

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	0.00	0.00%
	银华 300B	0.00	0.00%
	300 分级	562,990.36	0.67%
	合计	562,990.36	0.50%

对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华 300A	0
	银华 300B	0
	300 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华 300A	0
	银华 300B	0
	300 分级	0~10
	合计	0~10

§ 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	15,546,667.00	15,546,667.00	174,009,713.81
本报告期基金总申购份额	-	-	14,264,600.33
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	106,192,956.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-878,765.00	-878,765.00	1,757,530.00
本报告期期末基金份额总额	14,667,902.00	14,667,902.00	83,838,888.01

注：如有相应情况，拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为其审计的会计事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	123,914,836.46	14.47%	104,305.94	15.80%	-
华宝证券有限责任公司	3	111,809,954.78	13.06%	81,765.36	12.39%	-
广发证券股份有限公司	2	108,313,511.54	12.65%	86,074.92	13.04%	-
第一创业证券股份有限公司	2	106,350,678.07	12.42%	99,043.89	15.00%	-

西南证券股份有限公司	4	93,372,481.67	10.90%	86,958.00	13.17%	-
华泰证券股份有限公司	4	89,584,811.32	10.46%	65,513.06	9.93%	-
东方财富证券股份有限公司	2	77,874,493.33	9.09%	18,012.37	2.73%	新增 2 个交易日
中信证券股份有限公司	2	63,704,955.49	7.44%	46,587.44	7.06%	撤销 1 个交易日
方正证券股份有限公司	4	22,974,978.64	2.68%	21,396.66	3.24%	撤销 1 个交易日
华创证券有限责任公司	2	18,922,081.14	2.21%	17,622.50	2.67%	-
招商证券股份有限公司	2	14,718,573.09	1.72%	13,707.48	2.08%	-
西部证券股份有限公司	3	11,143,161.96	1.30%	8,149.09	1.23%	-
东方证券股份有限公司	3	8,730,004.08	1.02%	6,384.19	0.97%	-
中泰证券股份有限公司	1	2,938,228.09	0.34%	2,736.43	0.41%	-
光大证券股份有限公司	2	1,511,386.59	0.18%	1,407.66	0.21%	-
长城证券股份有限公司	3	478,884.12	0.06%	445.98	0.07%	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	撤销 1 个交易日
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
南京证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
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	0	-	-	-	-	撤销 2 个 交易单元
天风证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	4	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有	-	-	-	-	-	-

限责任公司						
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

宏信证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 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	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

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旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 1 月 18 日
2	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 18 日
3	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金暂停场内大额申购业务的公	上海证券报、中国证监会基金电子披露	2020 年 3 月 16 日

	告》	网站及本基金管理人网站	
4	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
5	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
6	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 20 日
7	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 20 日
8	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 20 日
9	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 20 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 20 日
11	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金调整场外大额申购（含定期定额投资）业务限额并暂停场内份额分拆业务的公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
13	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
14	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 18 日
15	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基	2020 年 4 月 18 日

		金管理人网站	
16	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过平安证券股份有限公司办理场外定期定额投资起始金额的公告》	上海证券报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 22 日
18	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
19	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 5 月 20 日
20	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 5 月 21 日
21	《银华沪深 300 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 5 月 22 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

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

本基金管理人于 2020 年 3 月 20 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

§ 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

2020 年 8 月 28 日