

银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2011 年 2 月 9 日证监许可【2011】179 号文核准募集。

本基金的基金合同生效日期：2011 年 3 月 17 日。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险（如指数化投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额配对转换业务及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等）和投资股指期货的风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日银华 90 份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额（包括银华金利份额、银华鑫利份额和银华 90 份额）的 10% 时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部银华 90 份额。

投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投

资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本招募说明书、本基金的基金份额发售公告以及相关公告。

本招募说明书摘要（更新）所载内容截止日为2014年3月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日，所披露的投资组合为2014年第1季度的数据（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称

银华基金管理有限公司

住所

广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层

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

法定代表人

王珠林

设立日期

2001年5月28日

批准设立机关
中国证监会
批准设立文号
中国证监会证监基金字[2001]7号

组织形式
有限责任公司
注册资本
2亿元人民币

存续期间
持续经营
联系人
刘晓雅

电话
010-85186558
传真
010-58163027

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股权结构为西南证券股份有限公司(出资比例:49%)、第一创业证券股份有限公司(出资比例:29%)、东北

证券股份有限公司（出资比例：21%）及山西海鑫实业股份有限公司（出资比例：1%）。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“风险控制委员会”和“薪酬与提名委员会”2个专门委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由4位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理部、量化投资部、研究部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、境外投资部、特定资产管理部、交易管理部、固定收益部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、公司办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部、战略发展部等19个职能部门，并设有北京分公司。此外，公司还设有A股基金投资决策委员会、境外投资决策委员会、特定资产投资决策委员会3个投资决策委员会，分别负责指导基金及其他投资组合的运作，确定基本的投资策略。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

王珠林先生：董事长，经济学博士。曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师；甘肃省证券公司发行部经理；中国蓝星化学工业总公司处长，蓝星清洗股份有限公司董事、副总经理、董事会秘书，蓝星化工新材料股份公司筹备组组长；西南证券有限责任公司副总裁；中国银河证券股份有限公司副总裁；西南证券股份有限公司董事、总裁。此外，还曾先后担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、中国证券业协会投资银行业委员会委员、重庆市证券期货业协会会长、盐田港集团外部董事、国投电力控股股份有限公司独立董事、上海城投控股股份有限公司独立董事等职务。现任银华基金管理有限公司董事长、银华财富资本管理（北京）有限公司董事、西南证券股份有限公司董事、财政部资产评估准则委员会委员、北京大学公共经济管理研究中心研究员。

钱龙海先生：董事，经济学硕士。曾任北京京放投资管理顾问公司总经理助理；佛山证券有限责任公司副总经理。现任第一创业证券股份有限公司党委书记、董事、总裁，兼任第一创业投资管理有限公司董事长、第一创业摩根大通证券有限责任公司董事。还担任中国证券业协会第五届理事会理事，中国证券业协会投资银行业务委员会第五届副主任委员，深圳市证券业协会副会长。

矫正中先生：董事，中共党员，经济学硕士，中国注册会计师，中国注册会计师协会资深会员，中国证券业协会咨询委员会委员曾任吉林省财政厅工交企业财务处副处长（正处长级）；吉林省长岭县副县长；吉林省财政厅文教行政财务处处长；吉林省财政厅副厅长、厅长兼吉林省地税局局长；吉林省政府秘书长兼办公厅主任、副省长，兼吉林市代市长、书记。现任

东北证券股份有限公司董事长、党委书记。

周晓冬先生：董事，金融 MBA、国际商务师。曾任中国南光进出口总公司广东分公司总经理；上海海博鑫惠国际贸易有限公司董事、常务副总经理。现任海鑫钢铁集团有限公司董事长助理，兼任北京惠宇投资有限公司总经理。

王立新先生，董事总经理，经济学博士。历任中国工商银行总行科员；南方证券股份有限公司基金部副处长；南方基金管理有限公司研究开发部、市场拓展部总监；银华基金管理有限公司总经理助理、副总经理、代总经理、代董事长。现任银华基金管理有限公司总经理、银华财富资本管理（北京）有限公司董事长。

郑秉文先生，独立董事，经济学博士后，教授，博士生导师。曾任中国社会科学院培训中心主任，院长助理，副院长。现任中国社会科学院拉美研究所所长。

王恬先生：独立董事，大学学历，高级经济师。曾任中国银行深圳分行行长，深圳天骥基金董事，中国国际财务有限公司（深圳）董事长，首长四方（集团）有限公司执行董事。现任南方国际租赁有限公司董事、总裁。

陆志芳先生，独立董事，法律硕士，律师。曾任对外经济贸易大学法律系副主任，北京仲裁委员会仲裁员，北京市律师协会国际业务委员会副主任委员，海问律师事务所律师、合伙人。现任浩天信和律师事务所律师、合伙人。

高歌女士：独立董事，法律硕士。曾任高阳科技控股有限公司助理总裁；普天系统集成公司副总经理；新华锦集团副总裁、副董事长。现任中国民主建国会青岛市委员会副主委、全国青联委员、中国青年企业家协会常务理事、新华锦集团副董事长。

周兰女士，监事会主席，中国社会科学院货币银行学专业研究生。曾任北京建材研究院财务科长；北京京放经济发展公司计财部经理；佛山证券有限责任公司监事长及风险控制委员会委员。现任第一创业证券股份有限公司监事长及风险控制委员会委员。

王致贤先生，监事，硕士。曾任重庆市地方税务局办公室秘书、重庆市政府办公厅一处秘书、重庆市国有资产监督管理委员会办公室秘书、重庆市国有资产监督管理委员会企业管理三处副处长。现任西南证券股份有限公司办公室（党委办公室）主任、证券事务代表。

龚飒女士：监事，硕士学历。曾任湖南海利化工有限公司财务会计；湘财证券有限责任公司分支机构财务负责人；泰达荷银基金管理有限公司基金事业部副总经理；湘财证券有限责任公司稽核经理；交银施罗德基金管理有限公司运营部总经理。现任银华基金管理有限公司运作保障部总监。

杜永军先生：监事，大专学历。曾任五洲大酒店财务部收款主管；北京赛特饭店财务部收款主管、收款主任、经理助理、副经理、经理。现任银华基金管理有限公司行政财务部总监助理。

封树标先生：副总经理，工学硕士。曾任国信证券天津营业部经理、平安证券综合研究所

副所长、平安证券资产管理事业部总经理、平安大华基金管理有限责任公司总经理、广发基金机构投资部总经理等职。2011年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司总经理助理职务，现任银华基金管理有限公司副总经理，同时兼任公司特定资产管理业务投资经理。

周毅先生：副总经理，硕士学位。曾任美国普华永道金融服务部部门经理、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，曾担任银华全球核心优选证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）及银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理和公司总经理助理职务。现任银华基金管理有限公司副总经理，兼任公司量化投资总监、量化投资部总监以及境外投资部总监、银华财富资本管理（北京）有限公司董事，并同时兼任银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理职务。

凌宇翔先生，督察长，工商管理硕士。曾任机械工业部主任科员；重庆国际信托投资公司研发中心部门经理；西南证券有限责任公司基金管理部总经理。现任银华基金管理有限公司督察长。

2. 本基金基金经理

张凯先生，硕士学位。2009年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司金融工程助理分析师、基金经理助理等职务，自2012年11月14日起担任本基金基金经理，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。

本基金历任基金经理：

王琦先生，2011年3月17日至2012年12月3日期间担任本基金基金经理。

3. A股基金投资决策委员会成员

委员会主席：王立新

委员：封树标、周毅、王华、姜永康、郭建兴

王立新先生：详见主要人员情况。

封树标先生：详见主要人员情况。

周毅先生：详见主要人员情况。

王华先生，硕士学位，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于西南证券有限责任公司。2000年10月加盟银华基金管理有限公司（筹），先后在研究策划部、基金经理部工作，曾任银华保本增值证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理。现任银华中小盘精选股票型证券投资基金基金经理、公司总经理助理、投资管理部总监及A股基金投资总监。

姜永康先生，硕士学位。2001年至2005年曾就职于中国平安保险（集团）股份有限公司，历任研究员、组合经理等职。2005年9月加盟银华基金管理有限公司，曾任养老金管理部投资经理职务。曾担任银华货币市场证券投资基金基金经理。现任公司总经理助理、固定收益部总监及固定收益基金投资总监以及银华财富资本管理（北京）有限公司董事，并同时担任银华保本增值证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金以及银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理。

郭建兴先生，学士学位。曾在山西证券股份有限公司（原山西证券有限责任公司）从事证券自营业务工作，历任交易主管、总经理助理兼监理事务；并曾就职于华商基金管理有限公司投资管理部，曾担任华商领先企业混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司，现任银华优质增长股票型证券投资基金基金经理。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的

商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二) 主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售

业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 311 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1. 直销机构

（1）银华基金管理有限公司北京直销中心

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

电话

010-58162950

传真

010-58162951

联系人

展璐

网址

www.yhfund.com.cn

全国统一客户服务电话

400-678-3333

(2) 银华基金管理有限公司深圳直销中心

地址

广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层

电话

0755-83515002

传真

0755-83515082

联系人

饶艳艳

(3) 银华基金管理有限公司网上直销交易系统

网上交易网址

trade.yhfund.com.cn/etrading

手机交易网站

m.yhfund.com.cn

客户服务电话

010-85186558, 4006783333

2. 代销机构

(1) 场外代销机构

1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址

北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人
王洪章

客服电话
95533
网址
www.ccb.com

2) 中国银行股份有限公司

注册地址
北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人
田国立

客服电话
95566
网址
www.boc.cn

3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址

中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人

姜建清

客服电话

95588

网址

www.icbc.com.cn

4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址
北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人
蒋超良

客服电话
95599
网址
www.abchina.com

5) 交通银行股份有限公司

注册地址
上海市银城中路 188 号

法定代表人
牛锡明

客服电话
95559

网址

www.bankcomm.com

6) 招商银行股份有限公司

注册地址

深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人

傅育宁

客服电话

95555

网址

www.cmbchina.com

7) 中国民生银行股份有限公司

注册地址

北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人

董文标

客服电话

95568

网址

www.cmbc.com.cn

8) 平安银行股份有限公司

注册地址

中国深圳市深南东路 5047 号

法定代表人

孙建一

客服电话

95511-3

网址

<http://bank.pingan.com/>

9) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址

上海市浦东新区浦东南路 500 号

法定代表人

吉晓辉

客服电话

95528

网址

www.spdb.com.cn

10) 华夏银行股份有限公司

注册地址

北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人

吴建

客服电话

95577

网址

www.hxb.com.cn

11) 北京银行股份有限公司

注册地址

北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人

闫冰竹

联系人

谢小华

客服电话

95526

网址

www.bankofbeijing.com.cn

12) 中信银行股份有限公司

注册地址

北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人

常振明

联系人

丰靖

客服电话

95558

网址

<http://bank.ecitic.com>

13) 东莞银行股份有限公司

注册地址

东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人

廖玉林

联系人

陈幸

客服电话

40011-96228

网址

www.dongguanbank.cn

14) 杭州银行股份有限公司

注册地址

杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人

吴太普

联系人

严峻

客服电话

0571-96523、400-8888-508

网址

www.hzbank.com.cn

15) 宁波银行股份有限公司

注册地址

宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人

陆华裕

联系人

胡技勋

客服电话
96528, 上海、北京地区 962528
网址
www.nccb.com.cn

16) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址
上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人
胡平西
联系人
吴海平

客服电话
021—962999
网址
www.srcb.com

17) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址

新疆乌鲁木齐市新华北路 8 号

法定代表人

农惠臣

联系人

何佳

客服电话

96518

网址

www.uccb.com.cn

18) 重庆银行股份有限公司

注册地址

重庆市渝中区邹容路 153 号

法定代表人

马千真

联系人

孔文超

客服电话

96899（重庆地区）；400-709-6899（其他地区）

网址

www.cqcbank.com

19) 厦门银行股份有限公司

注册地址

厦门市湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人

吴世群

联系人

林黎云

客服电话

400-858-8888

网址

<http://www.xmccb.com>

20) 渤海证券股份有限公司

注册地址

天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人

杜庆平

联系人

胡天彤

客服电话

400-6515-988

网址

<http://www.bhzq.com>

21) 大通证券股份有限公司

注册地址

辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

法定代表人

张智河

联系人

谢立军

客服电话

4008-169-169

网址

www.daton.com.cn

22) 大同证券经纪有限责任公司

注册地址

山西省大同市大北街 13 号

法定代表人

董祥

联系人

薛津

客服电话

4007121212

网址

<http://www.dtsbc.com.cn/>

23) 东北证券股份有限公司

注册地址

长春市自由大路 1138 号

法定代表人

矫正中

联系人

安岩岩

客服电话

400-600-0686 ; 0431-85096733

网址

www.nesc.cn

24) 国都证券有限责任公司

注册地址

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人

常喆

客服电话

400-818-8118

网址

www.guodu.com

25) 国开证券有限责任公司

注册地址

北京市朝阳区安华外馆斜街甲1号泰利明苑写字楼A座二区4层

法定代表人
黎维彬
联系人
朱瑜

客服电话
010-51789309
网址
www.gkzq.com.cn

26) 恒泰证券股份有限公司

注册地址
内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人
庞介民
联系人
王旭华

客服电话
0471-4960762

网址

www.cnht.com.cn

27) 宏源证券股份有限公司

注册地址

新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人

冯戎

联系人

李巍

客服电话

400-800-0562

网址

www.hysec.com

28) 华龙证券有限责任公司

注册地址

兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 4 楼

法定代表人

李晓安

联系人

李昕田

客服电话

0931-96668、4006898888

网址

www.hlzqgs.com

29) 华融证券股份有限公司

注册地址

北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人

祝献忠

联系人
黄恒

客服电话
010-58568118

网址
www.hrsec.com.cn

30) 江海证券有限公司

注册地址
哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人
孙名扬
联系人
张背北

客服电话
400-666-2288
网址
www.jhzq.com.cn

31) 开源证券有限责任公司

注册地址

西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人

李刚

联系人

王姣

客服电话

400-860-8866

网址

www.kysec.cn

32) 联讯证券有限责任公司

注册地址

中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

法定代表人

徐刚

联系人

郭晴

客服电话

95564

网址

www.lxzq.com.cn

33) 齐鲁证券有限公司

注册地址

山东省济南市经七路 86 号

法定代表人

李玮

联系人

吴阳

客服电话

95538

网址

www.qlzq.com.cn

34) 日信证券有限责任公司

注册地址

呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人

孔佑杰

联系人

文思婷

客服电话

400-660-9839

网址

<http://www.rxzq.com.cn>

35) 瑞银证券有限责任公司

注册地址

北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人

程宜荪

客服电话

400-887-8827

网址

www.ubssecurities.com

36) 山西证券股份有限公司

注册地址

太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人

侯巍

联系人

郭熠

客服电话

400-666-1618

网址

www.i618.com.cn

37) 天相投资顾问有限公司

注册地址

北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人

林义相

联系人

尹伶

客服电话

010-66045678

网址

www.jjm.com.cn

38) 西部证券股份有限公司

注册地址

西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人

刘建武

联系人

刘莹

客服电话

95582

网址

www.westsecu.com.cn

39) 信达证券股份有限公司

注册地址

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人

张志刚

联系人

唐静

客服电话

400-800-8899

网址

www.cindasc.com

40) 中国民族证券有限责任公司

注册地址

北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

法定代表人

赵大建

联系人

李微

客服电话
4008895618
网址
www.e5618.com

41) 中国银河证券股份有限公司

注册地址
北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人
陈有安
联系人
宋明

客服电话
400-888-8888
网址
www.chinastock.com.cn

42) 中天证券有限责任公司

注册地址

辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 号甲

法定代表人

马功勋

联系人

袁劲松

客服电话

400-6180-315

网址

www.stockren.com

43) 中信建投证券股份有限公司

注册地址

北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人

王常青

联系人

权唐

客服电话

400-8888-108

网址

www.csc108.com

44) 中信万通证券有限责任公司

注册地址

青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

法定代表人

杨宝林

联系人

吴忠超

客服电话

0532-96577

网址

www.zxwt.com.cn

45) 中信证券股份有限公司

注册地址

深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人

王东明

联系人

腾艳

客服电话

95558

网址

www.citics.com

46) 中原证券股份有限公司

注册地址

郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人

菅明军

联系人

程月艳

客服电话

967218 ; 400-813-9666

网址

www.ccnew.com

47) 爱建证券有限责任公司

注册地址

上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人

郭林

联系人

戴莉丽

网址

www.ajzq.com

48) 安信证券股份有限公司

注册地址

深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人

牛冠兴

客服电话

400-800-1001

网址

www.essence.com.cn

49) 财通证券有限责任公司

注册地址

杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人

沈继宁

客服电话

0571-96336, 962336 (上海地区)

网址

www.ctsec.com

50) 长城证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人
黄耀华

客服电话
0755-33680000; 400-6666-888
网址
www.cgws.com

51) 长江证券股份有限公司

注册地址
武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人
杨泽柱
联系人
李良

客服电话
95579; 400-8888-999
网址
www.95579.com

52) 德邦证券有限责任公司

注册地址

上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人

姚文平

客服电话

400-888-8128

网址

www.tebon.com.cn

53) 第一创业证券股份有限公司

注册地址

深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人

刘学民

客服电话

400-888-1888

网址

www.fcsc.com

54) 东方证券股份有限公司

注册地址

上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

法定代表人

潘鑫军

联系人

胡月茹

客服电话

95503

网址

www.dfzq.com.cn

55) 东莞证券有限责任公司

注册地址

东莞市莞城可园南路1号

法定代表人

张运勇

客服电话

0769-961130

网址

www.dgzq.com.cn

56) 东海证券股份有限公司

注册地址

江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人

刘化军

联系人

梁旭

客服电话

95531; 400-8888-588

网址

<http://www.longone.com.cn>

57) 东吴证券股份有限公司

注册地址

苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人

范力

联系人
方晓丹

客服电话
4008-601-555

网址
<http://www.dwzq.com.cn>

58) 方正证券股份有限公司

注册地址
北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 11 层

法定代表人
雷杰

客服电话
95571
网址
<http://www.foundersc.com>

59) 光大证券股份有限公司

注册地址

上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人

薛峰

联系人

刘晨

客服电话

10108998; 95525; 400-888-8788

网址

www.ebscn.com

60) 广发证券股份有限公司

注册地址

广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人

孙树明

联系人

黄岚

客服电话

95575 或致电各地营业网点

网址

<http://www.gf.com.cn>

61) 广州证券有限责任公司

注册地址

广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人

刘东

联系人

林洁茹

客服电话

020-961303

网址

www.gzs.com.cn

62) 国海证券股份有限公司

注册地址

广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人

张雅锋

联系人

牛孟宇

客服电话

95563

网址

www.ghzq.com.cn

63) 国金证券股份有限公司

注册地址

成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人

冉云

联系人

刘一宏

客服电话

4006-600109

网址

www.gjq.com.cn

64) 国盛证券有限责任公司

注册地址

江西省南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）

法定代表人
曾小普
联系人
陈明

客服电话
400-8222-111
网址
www.gsstock.com

65) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址
上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人
万建华

客服电话
400-8888-666
网址
www.gtja.com

66) 国信证券股份有限公司

注册地址

深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人

何如

联系人

齐晓燕

客服电话

95536

网址

www.guosen.com.cn

67) 国元证券股份有限公司

注册地址
安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人
蔡咏
联系人
祝丽萍

客服电话
400-8888-777
网址
www.gyzq.com.cn

68) 海通证券股份有限公司

注册地址
上海市广东路 689 号

法定代表人
王开国
联系人
李笑鸣

客服电话
95553 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址
www.htsec.com

69) 红塔证券股份有限公司

注册地址
云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人
况雨林
联系人
高国泽

客服电话
400-871-8880
网址
www.hongtastock.com

70) 华安证券股份有限公司

注册地址

安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人

李工

联系人

甘霖

客服电话

96518(安徽); 400-809-6518(全国)

网址

www.hazq.com

71) 华宝证券有限责任公司

注册地址

上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人
陈林

客服电话
400-820-9898
网址
www.cnhbstock.com

72) 华福证券有限责任公司

注册地址
福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人
黄金琳

客服电话
96326（福建省外请先拨 0591）
网址
www.hfzq.com.cn

73) 华林证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼

法定代表人

薛荣年

联系人

王叶平

客服电话

全国统一客服热线 400-188-3888;

全国统一电话委托号码：400-880-2888

网址

www.chinalions.com

74) 华泰证券股份有限公司

注册地址

江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人

吴万善

客服电话

95597

网址

www.htsc.com.cn

75) 华鑫证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人

洪家新

联系人

陈敏

客服电话

021-32109999; 029-68918888

网址

www.cfsc.com.cn

76) 金元证券股份有限公司

注册地址

海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

法定代表人

陆涛

客服电话

400-888-8228

网址

www.jyzq.cn

77) 南京证券有限责任公司

注册地址

江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人

张华东

客服电话

400-828-5888

网址

www.njq.com.cn

78) 平安证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人
杨宇翔

客服电话

95511-8

网址

<http://www.pingan.com>

79) 厦门证券有限公司

注册地址

厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人

傅毅辉

客服电话

0592-5163588

网址

www.xmzq.cn

80) 上海证券有限责任公司

注册地址

上海市西藏中路 336 号

法定代表人

龚德雄

联系人

张瑾

客服电话

400-891-8918; 021-962518

网址

<http://www.962518.com>

81) 申银万国证券股份有限公司

注册地址

上海市常熟路 171 号

法定代表人
储晓明

客服电话
95523; 400-889-5523
网址
www.sywg.com

82) 天风证券股份有限公司

注册地址
湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

法定代表人
余磊
联系人
刘鑫

客服电话
028-86711410; 027-87618882

网址

www.tfzq.com

83) 万联证券有限责任公司

注册地址

广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人

张建军

联系人

王鑫

客服电话

400-8888-133

网址

www.wlzq.com.cn

84) 五矿证券有限公司

注册地址

深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

法定代表人

张永衡

联系人

赖君伟

客服电话

400-184-0028

网址

www.wkzq.com.cn

85) 西藏同信证券有限责任公司

注册地址

西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

法定代表人

贾绍君

联系人
王钧

客服电话
400-881-1177
网址
www.xzsec.com

86) 西南证券股份有限公司

注册地址
重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人
余维佳

客服电话
400-809-6096
网址
www.swsc.com.cn

87) 湘财证券有限责任公司

注册地址

湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人

林俊波

联系人

赵小明

客服电话

400-888-1551

网址

www.xcsc.com

88) 兴业证券股份有限公司

注册地址

福州市湖东路 268 号

法定代表人
兰荣

客服电话
95562
网址
www.xyzq.com.cn

89) 英大证券有限责任公司

注册地址
深圳市福田区深南中路华能大厦 30、31 层

法定代表人
吴骏

客服电话
4000-188-688
网址
www.ydsc.com.cn

90) 招商证券股份有限公司

注册地址

深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人

宫少林

联系人

林生迎

客服电话

400-8888-111; 95565

网址

www.newone.com.cn

91) 浙商证券股份有限公司

注册地址

浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6/7

法定代表人

吴承根

客服电话

0571-967777

网址

www.stocke.com.cn

92) 中国中投证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

法定代表人

龙增来

联系人

刘毅

客服电话

4006-008-008、95532

网址

www.china-invs.cn

93) 中航证券有限公司

注册地址

南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人

杜航

联系人

戴蕾

客服电话

400-8866-567

网址

www.avicsec.com

94) 中山证券有限责任公司

注册地址

深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 29 层

法定代表人

吴永良

联系人

刘军

客服电话

400-1022-011

网址

<http://www.zszq.com/>

95) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址

浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层

法定代表人

沈强

联系人

王霏霏

客服电话

95548

网址

www.bigsun.com.cn

96) 中银国际证券有限责任公司

注册地址

上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人

许刚

联系人

李丹

客服电话

400-620-8888

网址

www.bocichina.com

(以上排名不分先后)

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

(2) 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

(二) 注册登记机构

名称

中国证券登记结算有限责任公司

住所及办公地址

北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人

金颖

联系人

崔巍

电话

010-66210988, 010-59378888

传真

010-66210938

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称

上海市通力律师事务所

住所及办公地址

上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人

韩炯

联系人

黎明

电话

021-31358666

传真

021-31358600

经办律师
吕红、黎明

(四) 会计师事务所及经办注册会计师

名称
安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

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安永大楼（即东3办公楼）16层

执行事务人
吴港平
联系人
王珊珊

电话
010-58153280；010-58152145
传真
010-85188298

经办注册会计师
李慧民、王珊珊

四、基金名称

银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

五、基金类型

股票型基金

六、投资目标

本基金力争对中证等权重 90 指数进行有效跟踪，并力争将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控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以分享中国经济的持续、稳定增长成果，实现基金资产的长期增值。

七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证等权重 90 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%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证等权重 90 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、投资策略

本基金采用完全复制法，按照成份股在中证等权重 90 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证等权重 90 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证等权重 90 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，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1. 资产配置策略

本基金管理人主要按照中证等权重 90 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证等权重 90 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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。

2. 股票投资组合构建

（1）组合构建原则

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证等权重 90 指数的收益表现。

（2）组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证等权重 90 指数的收益表现。

（3）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证等权重 90 指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证等权重 90 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

① 定期调整

根据中证等权重 90 指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

② 临时调整

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证等权重 90 指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在中证等权重 90 指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

③ 其他调整

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股申购，所申购的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

(4) 投资绩效评估

可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中进行相关公告。在正常市场情况下，本基金力争实现年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

3. 股指期货投资策略

本基金管理人对股指期货的运用将进行充分的论证。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要通过研究对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。

九、业绩比较基准

$95\% \times \text{中证等权重 90 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$

由于本基金投资标的指数为中证等权重 90 指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证等权重 90 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、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。从本基金所分离的两类基金份额来看，银华金利份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华鑫利份额具有高风险、高预期收益的特征。

十一、投资组合报告

基金管理人银华基金管理有限公司的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2014 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	1,540,986,846.49	94.45
---	------	------------------	-------

其中：股票	1,540,986,846.49	94.45
-------	------------------	-------

2	固定收益投资		
---	--------	--	--

-
-

其中：债券

-
-

资产支持证券

-
-

3
贵金属投资

-
-

4
金融衍生品投资

-
-

5
买入返售金融资产

-
-

其中：买断式回购的买入返售金融资产

-

-

6

银行存款和结算备付金合计

90,348,759.13

5.54

7

其他资产

174,314.90

0.01

8

合计

1,631,509,920.52

100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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
164,508,849.17
10.10

C
制造业
670,512,018.66
41.17

D
电力、热力、燃气及水生产和供应业
—
—

E
建筑业

45,543,175.00

2.80

F

批发和零售业

14,388,760.62

0.88

G

交通运输、仓储和邮政业

34,828,743.60

2.14

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

52,438,881.22

3.22

J

金融业

416,014,287.39

25.54

K

房地产业

94,200,882.18

5.78

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

33,512,698.13

2.06

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

15,038,550.52

0.92

合计

1,540,986,846.49

94.62

2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002594	比亚迪	521,543	25,091,433.73	1.54
---	--------	-----	---------	---------------	------

2	002304	洋河股份	458,789	22,567,830.91	1.39
---	--------	------	---------	---------------	------

3	600519	贵州茅台	143,481		
---	--------	------	---------	--	--

22,196,510.70
1.36

4
600383
金地集团
3,155,604
21,836,779.68
1.34

5
000100
TCL 集团
8,249,045
20,870,083.85
1.28

6
000725
京东方 A
9,205,803
20,713,056.75
1.27

7
600010
包钢股份
5,050,312
20,302,254.24
1.25

8
600015
华夏银行
2,384,488
20,125,078.72
1.24

9
600028
中国石化
3,999,110
20,115,523.30
1.24

10
000858
五粮液
1,177,621
19,630,942.07
1.21

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

1.4 报告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。

1.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

1.7 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。

1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 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。

1.10 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。

1.11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券中包括中国石化（股票代码：600028）和五粮液（股票代码：000858）。

根据中国石化股票发行主体中国石油化工股份有限公司于2014年1月12日发布的公告，国务院对山东省青岛市“11·22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议，对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元，中国石油化工股份有限公司将承担其相应赔偿责任。相关资金主要来自中国石化在以前年度积累的安全生产保险基金（指经国家有关部门批准由中国石油化工集团公司面向公司所属企事业单位设立的企业安全生产保险基金）和公司向商业保险公司投保的商业巨灾保险的保险理赔资金。

根据五粮液股票发行主体宜宾五粮液股份有限公司于2013年2月23日发布的公告，该上市公司的控股子公司宜宾五粮液酒类销售有限责任公司由于在销售过程中存在违反《中华人民共和国反垄断法》的行为而受到了四川省发改委的行政处罚，罚款金额为2.02亿元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和析，认为上述处罚不会对中国石化和五粮液的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述上市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八名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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	99,813.04
---	-------	-----------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	
---	------	--

20,241.66

5

应收申购款

54,260.20

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

174,314.90

11.4 报告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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告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。

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

11.6 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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段

净值增长率①

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

2011.3.17（基金合同生效日）至 2011.12.31

-28.80%

1.19%

-28.20%
1.22%
-0.60%
-0.03%

2012 年
6.31%
1.31%
5.92%
1.34%
0.39%
-0.03%

2013 年
-13.14%
1.35%
-15.43%
1.35%
2.29%
0.00%

2014. 1. 1 至 2014. 3. 31
-8.84%
1.17%
-8.51%
1.18%
-0.33%
-0.01%

2011. 3. 17 (基金合同生效日) 至 2014. 3. 31
-40.06%
1.28%

- 41.16%
- 1.30%
- 1.10%
- 0.02%

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 证券账户开户费用、银行账户维护费；
9. 基金上市初费和上市月费；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人按照法律法规规定在指定媒体上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原更新招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期；
- 2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的概况及主要人员情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，增加中国民族证券有限责任公司为代销机构，并更新了部分代销机构的资料；
- 4、在“十二、基金的投资”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容；
- 5、在“十三、基金的业绩”部分内容，更新了截至 2014 年 3 月 31 日的基金投资业绩；
- 6、在“二十六、其他应披露事项”，列出了自上次招募说明书公告之日以来涉及本基金的重要公告；
- 7、对部分表述进行了更新。

银华基金管理有限公司

2014 年 4 月 30 日