

银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

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

送出日期：2014 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 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	5
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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
7.7 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.....	37
7.8 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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金		
基金简称	银华中证等权 90 指数分级		
场内简称	银华 90		
基金主代码	161816		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 17 日		
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		
报告期末基金份额总额	1,850,885,823.44 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	2011 年 4 月 8 日		
下属分级基金的基金简称	银华金利	银华鑫利	银华 90
下属分级基金的交易代码	150030	150031	161816
报告期末下属分级基金份额总额	590,565,337.00 份	590,565,337.00 份	669,755,149.44 份

2.2 基金产品说明

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

业绩比较基准	95%×中证等权重 90 指数收益率 + 5%×商业银行人民币活期存款利率（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。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。		
下属三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	凌宇翔	田青
	联系电话	(010) 58163000	(010) 67595096
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	(010) 67595096
传真		(010) 58163027	(010) 66275853
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王珠林	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-145,988,310.01
本期利润	-138,450,102.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0723
本期加权平均净值利润率	-8.25%
本期基金份额净值增长率	-7.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,036,781,326.13
期末可供分配基金份额利润	-0.5602
期末基金资产净值	1,608,424,459.20
期末基金份额净值	0.869
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-39.15%

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

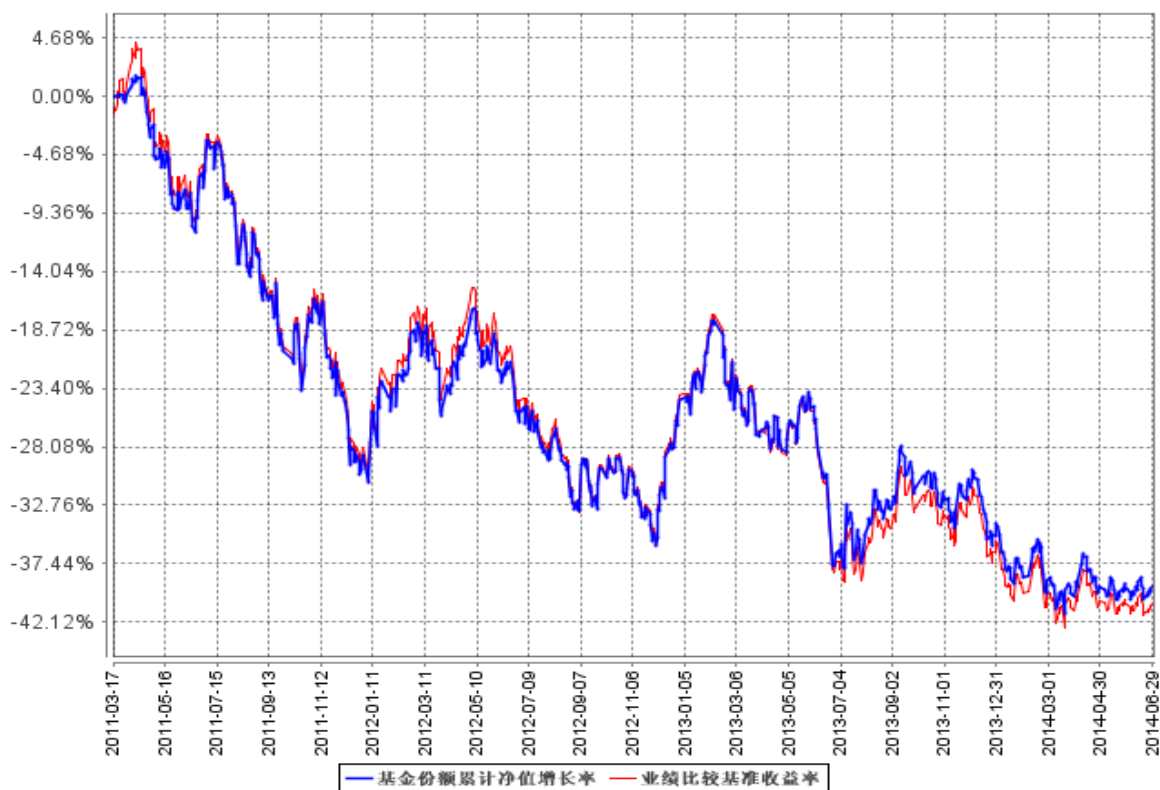
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.46%	0.74%	0.10%	0.75%	0.36%	-0.01%
过去三个月	1.52%	0.82%	0.94%	0.83%	0.58%	-0.01%
过去六个月	-7.45%	1.01%	-7.65%	1.01%	0.20%	0.00%
过去一年	-4.00%	1.14%	-5.27%	1.14%	1.27%	0.00%
过去三年	-35.34%	1.28%	-37.21%	1.29%	1.87%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-39.15%	1.25%	-40.60%	1.27%	1.45%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证等权重 90 指数收益率 + $5\% \times$ 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 $95\% \times$ 中证等权重 90 指数收益率 + $5\% \times$ 商业银行人民币活期存款利率（税后）。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 40 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、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金。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	2012 年 11 月 14 日	-	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 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：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证等权重 90 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，本公司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 9 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，本基金运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽管报告期间本基金多次发生大额申购赎回，本基金仍将跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.869 元，本报告期份额净值增长率为-7.45%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%。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

回顾本年度上半年，A 股市场一直呈现大幅震荡的状态，投资者一方面担心经济硬着陆，另一方面又担心刺激政策重回老路，导致情绪波动较大，此外，IPO 的重启也一度引发市场对供给过大的担忧，以沪指为代表的权重指数屡探前期低点。在“稳增长”的基调下，政府果断采取了多种创新性的政策应对，对结构进行调整的同时也保持了对经济微幅刺激，经济企稳的迹象逐步明显。板块方面，大小盘的跷跷板效应更为明显，且“大盘搭台，小盘唱戏”的格局不断延续，反映出投资者对成长和创新的高预期。对于市场未来走势，我们认为随着政策微刺激的延续及经济的逐步企稳，市场预期将呈现震荡向上的格局。

本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标，期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括银华 90 份额、银华金利份额、银华鑫利份额）不进行收益分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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：银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	92,639,744.68	111,322,808.26
结算备付金		-	-
存出保证金		46,166.63	143,487.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,519,151,888.70	1,800,866,737.27

其中：股票投资		1, 519, 151, 888. 70	1, 800, 866, 737. 27
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	18, 541. 84	24, 404. 48
应收股利		-	-
应收申购款		2, 575. 53	29, 314. 01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1, 611, 858, 917. 38	1, 912, 386, 751. 55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 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		-	-
应付赎回款		925, 183. 97	649, 759. 64
应付管理人报酬		1, 316, 576. 01	1, 659, 259. 25
应付托管费		289, 646. 75	365, 037. 05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	427, 539. 04	759, 467. 15
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	475, 512. 41	340, 974. 33
负债合计		3, 434, 458. 18	3, 774, 497. 42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2, 645, 205, 785. 33	2, 905, 114, 959. 15
未分配利润	6.4.7.10	-1, 036, 781, 326. 13	-996, 502, 705. 02
所有者权益合计		1, 608, 424, 459. 20	1, 908, 612, 254. 13
负债和所有者权益总计		1, 611, 858, 917. 38	1, 912, 386, 751. 55

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，银华 90 份额净值为人民币 0.869 元，银华金利份额净值为人民币 1.032 元，银华鑫利份额净值为人民币 0.706 元；基金份额总额为 1,850,885,823.44 份，其中银华 90 份额为 669,755,149.44 份，银华金利份额为 590,565,337.00 份，银华鑫利份额为 590,565,337.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-127,098,253.10	-413,015,189.69
1.利息收入		350,650.36	596,009.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	350,650.36	596,009.12
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）		-135,155,348.35	-36,477,233.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-150,541,995.19	-58,928,358.45
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		-	-
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	15,386,646.84	22,451,125.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,538,207.07	-378,086,434.32
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	168,237.82	952,468.60
减：二、费用		11,351,849.84	19,787,669.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,325,724.10	13,715,257.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,831,659.31	3,017,356.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	959,308.49	2,819,079.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	235,157.94	235,975.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-138,450,102.94	-432,802,859.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-138,450,102.94	-432,802,859.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	2,905,114,959.15	-996,502,705.02	1,908,612,254.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-138,450,102.94	-138,450,102.94
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）	-259,909,173.82	98,171,481.83	-161,737,691.99
其中：1.基金申购款	69,920,360.73	-26,496,361.22	43,423,999.51
2.基金赎回款	-329,829,534.55	124,667,843.05	-205,161,691.50
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）	2,645,205,785.33	-1,036,781,326.13	1,608,424,459.20
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	4,282,120,347.54	-1,039,260,597.72	3,242,859,749.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-432,802,859.55	-432,802,859.55
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）	-685,594,184.53	154,937,195.21	-530,656,989.32
其中：1.基金申购款	397,602,127.36	-100,170,372.66	297,431,754.70
2.基金赎回款	-1,083,196,311.89	255,107,567.87	-828,088,744.02
四、本期向基金份额持有	-	-	-

利份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对银华金利份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份银华 90 份额将按 1 份银华金利份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于银华金利份额期末的约定应得收益，即银华金利份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内银华 90 份额分配给银华金利份额持有人。银华 90 份额持有人持有的每 2 份银华 90 份额将按 1 份银华金利份额获得新增银华 90 份额的分配。持有场外银华 90 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华 90 份额的分配；持有场内银华 90 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华 90 份额的分配。经过上述份额折算，银华金利份额和银华 90 份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对银华金利份额和银华 90 份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金根据基金合同的规定，还将在以下两种情况进行份额折算，即：当银华 90 份额的基金份额净值达到 2.000 元；当银华鑫利份额的基金份额净值达到 0.250 元。当银华 90 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对银华金利份额、银华鑫利份额和银华 90 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华金利份额和银华鑫利份额的比例为 1:1，份额折算后银华金利份额、银华鑫利份额和银华 90 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当银华鑫利份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对银华金利份额、银华鑫利份额和银华 90 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华金利份额和银华鑫利份额的比例为 1:1，份额折算后银华 90 份额、银华金利份额和银华鑫利份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

银华 90 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。银华金利份额与银华鑫利份额交易代码不同，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。

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。

本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{中证等权重 90 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款}$

利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。（

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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、国家税务总局财税〔2012〕85 号《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，证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得实施差别化个人所得税政策。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。

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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	92,639,744.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	92,639,744.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,759,107,051.21	1,519,151,888.70	-239,955,162.51
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	1,759,107,051.21	1,519,151,888.70	-239,955,162.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,514.57
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	0.02
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	6.45
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.80
合计	18,541.84

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	427,539.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	427,539.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,015.61
预提费用	223,149.47
其他	250,347.33
合计	475,512.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,964,538,509.02	2,905,114,959.15
本期申购	817.53	1,209.53
本期赎回(以“-”号填列)	-532,529.70	-787,872.10
2014 年 1 月 2 日 基金拆分/份额折算前	1,964,006,796.85	2,904,328,296.58
基金拆分/份额折算变动份额	68,173,331.35	-
本期申购	48,932,329.08	69,919,151.20
本期赎回(以“-”号填列)	-230,226,633.84	-329,041,662.45
本期末	1,850,885,823.44	2,645,205,785.33

注：（1）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的规定，本基金以 2014 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对银华 90 的场外份额、场内份额以及银华金利份额实施定期份额折算。

（2）根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回银华 90 份额，银华金利份额和银华鑫利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金利份额和银华鑫利份额的情况。

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	-719,781,238.34	-276,721,466.68	-996,502,705.02
本期利润	-145,988,310.01	7,538,207.07	-138,450,102.94
本期基金份额交易产生的变动数	66,146,797.95	32,024,683.88	98,171,481.83
其中：基金申购款	-17,552,152.79	-8,944,208.43	-26,496,361.22
基金赎回款	83,698,950.74	40,968,892.31	124,667,843.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-799,622,750.40	-237,158,575.73	-1,036,781,326.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	4,723.44
其他	728.05
合计	350,650.36

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	360,144,854.52
减：卖出股票成本总额	510,686,849.71
买卖股票差价收入	-150,541,995.19

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,386,646.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,386,646.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,538,207.07
——股票投资	7,538,207.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	7,538,207.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	168,237.82
合计	168,237.82

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	959,308.49
银行间市场交易费用	-
合计	959,308.49

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行费用	2,408.47
账户服务费	9,000.00
上市费	29,752.78
其他	600.00
合计	235,157.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
银华基金管理有限公司	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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	30,107,105.80	5.18%	22,404,600.26	1.33%
东北证券	-	-	109,657,755.81	6.50%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	27,406.95	5.18%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券	97,036.21	6.35%	-	-
西南证券	20,397.04	1.34%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等）。

2、该类佣金协议的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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,325,724.10	13,715,257.63
其中：支付销售机构的客户维护费	1,062,338.35	1,666,691.43

注：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。由基金托管人

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,831,659.31	3,017,356.75

注：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。由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期间及上年度可比期间均未运用固有资金投资银华金利、银华鑫利、银华 90 基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有银华金利、银华鑫利、银华 90 基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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	92,639,744.68	345,198.87	132,471,407.89	572,466.28

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，本基金（包括银华 90 份额、银华金利份额、银华鑫利份额）不进行收益分配。

6.4.12 期末（2014 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**

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000562	宏源证券	2013 年 10 月 31 日	重大资产重组	8.22	2014 年 7 月 28 日	8.93	2,265,812	18,859,244.96	18,624,974.64	-
600637	百视通	2014 年 5 月 29 日	重大资产重组	32.03	-	-	488,835	19,798,952.68	15,657,385.05	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款及结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	92,639,744.68	-	-	-	-	-	92,639,744.68

存出保证金	46,166.63	-	-	-	-	-	46,166.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,519,151,888.70	1,519,151,888.70
应收利息	-	-	-	-	-	18,541.84	18,541.84
应收申购款	695.83	-	-	-	-	1,879.70	2,575.53
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	92,686,607.14	-	-	-	-	1,519,172,310.24	1,611,858,917.38
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	925,183.97	925,183.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,316,576.01	1,316,576.01
应付托管费	-	-	-	-	-	289,646.75	289,646.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	427,539.04	427,539.04
其他负债	-	-	-	-	-	475,512.41	475,512.41
负债总计	-	-	-	-	-	3,434,458.18	3,434,458.18
利率敏感度缺口	92,686,607.14	-	-	-	-	-1,515,737,852.06	1,608,424,459.20
上年度末 2013 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	111,322,808.26	-	-	-	-	-	111,322,808.26
存出保证金	143,487.53	-	-	-	-	-	143,487.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,800,866,737.27	1,800,866,737.27
应收利息	-	-	-	-	-	24,404.48	24,404.48
应收申购款	1,292.25	-	-	-	-	28,021.76	29,314.01
资产总计	111,467,588.04	-	-	-	-	1,800,919,163.51	1,912,386,751.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	649,759.64	649,759.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,659,259.25	1,659,259.25
应付托管费	-	-	-	-	-	365,037.05	365,037.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	759,467.15	759,467.15
其他负债	-	-	-	-	-	340,974.33	340,974.33
负债总计	-	-	-	-	-	3,774,497.42	3,774,497.42
利率敏感度缺口	111,467,588.04	-	-	-	-	-1,797,144,666.09	1,908,612,254.13

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于 2014 年 6 月 30 日及 2013 年末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来

现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金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。于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	1,519,151,888.70	94.45	1,800,866,737.27	94.35
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	1,519,151,888.70	94.45	1,800,866,737.27	94.35

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	+5%	79,122,871.00	95,099,111.60
-5%	-79,122,871.00	-95,099,111.60	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,519,151,888.70	94.25
	其中：股票	1,519,151,888.70	94.25
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	92,639,744.68	5.75
7	其他各项资产	67,284.00	0.00
8	合计	1,611,858,917.38	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	18,542,800.00	1.15
B	采矿业	102,949,786.43	6.40

C	制造业	656,930,301.21	40.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,202,176.60	3.18
F	批发和零售业	14,627,993.12	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	32,539,210.62	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,106,951.85	5.35
J	金融业	406,716,753.81	25.29
K	房地产业	81,625,629.05	5.07
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	34,329,981.07	2.13
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	17,121,936.00	1.06
S	综合	16,458,368.94	1.02
	合计	1,519,151,888.70	94.45

7.2.2 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。

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	000768	中航飞机	1,899,186	19,998,428.58	1.24
2	002230	科大讯飞	737,300	19,612,180.00	1.22
3	002081	金螳螂	1,356,797	19,212,245.52	1.19
4	002236	大华股份	692,447	18,661,446.65	1.16
5	000562	宏源证券	2,265,812	18,624,974.64	1.16
6	601118	海南橡胶	3,020,000	18,542,800.00	1.15
7	601989	中国重工	3,833,514	18,477,537.48	1.15
8	300070	碧水源	631,001	18,456,779.25	1.15
9	000333	美的集团	955,070	18,451,952.40	1.15
10	000423	东阿阿胶	550,327	18,336,895.64	1.14
11	601766	中国南车	4,036,256	18,163,152.00	1.13

12	000581	威孚高科	662,100	17,856,837.00	1.11
13	601299	中国北车	3,921,935	17,805,584.90	1.11
14	000625	长安汽车	1,445,060	17,788,688.60	1.11
15	000858	五粮液	991,141	17,771,158.13	1.10
16	600383	金地集团	1,997,635	17,758,975.15	1.10
17	000001	平安银行	1,779,883	17,638,640.53	1.10
18	600028	中国石化	3,344,343	17,624,687.61	1.10
19	601601	中国太保	984,847	17,520,428.13	1.09
20	000063	中兴通讯	1,332,432	17,481,507.84	1.09
21	002594	比亚迪	367,237	17,440,085.13	1.08
22	000783	长江证券	1,815,252	17,426,419.20	1.08
23	002353	杰瑞股份	432,762	17,418,670.50	1.08
24	600703	三安光电	743,300	17,415,519.00	1.08
25	000568	泸州老窖	1,062,151	17,398,033.38	1.08
26	600887	伊利股份	524,613	17,375,182.56	1.08
27	000623	吉林敖东	1,116,677	17,330,827.04	1.08
28	600196	复星医药	857,000	17,302,830.00	1.08
29	600104	上汽集团	1,130,332	17,294,079.60	1.08
30	000629	攀钢钒钛	8,312,612	17,290,232.96	1.07
31	002142	宁波银行	1,872,260	17,224,792.00	1.07
32	600050	中国联通	5,328,434	17,210,841.82	1.07
33	600030	中信证券	1,500,878	17,200,061.88	1.07
34	601818	光大银行	6,771,512	17,199,640.48	1.07
35	601166	兴业银行	1,714,757	17,199,012.71	1.07
36	600036	招商银行	1,678,496	17,187,799.04	1.07
37	600406	国电南瑞	1,287,566	17,163,254.78	1.07
38	601169	北京银行	2,128,088	17,152,389.28	1.07
39	600111	包钢稀土	871,873	17,132,304.45	1.07
40	300027	华谊兄弟	715,800	17,121,936.00	1.06
41	000725	京东方 A	7,884,175	17,108,659.75	1.06
42	600519	贵州茅台	120,465	17,103,620.70	1.06
43	601328	交通银行	4,405,254	17,092,385.52	1.06
44	000983	西山煤电	3,241,216	17,081,208.32	1.06
45	000895	双汇发展	476,836	17,065,960.44	1.06
46	000338	潍柴动力	958,273	17,047,676.67	1.06
47	600547	山东黄金	1,099,553	17,021,080.44	1.06
48	601088	中国神华	1,170,183	17,014,460.82	1.06
49	601336	新华保险	804,112	16,990,886.56	1.06
50	000651	格力电器	576,682	16,983,284.90	1.06

51	600016	民生银行	2,729,790	16,951,995.90	1.05
52	600999	招商证券	1,676,319	16,947,585.09	1.05
53	600837	海通证券	1,851,256	16,938,992.40	1.05
54	601857	中国石油	2,243,782	16,918,116.28	1.05
55	600015	华夏银行	2,063,154	16,917,862.80	1.05
56	600089	特变电工	1,982,400	16,830,576.00	1.05
57	002241	歌尔声学	630,466	16,808,223.56	1.05
58	002415	海康威视	991,874	16,802,345.56	1.04
59	601288	农业银行	6,663,131	16,791,090.12	1.04
60	000792	盐湖股份	1,110,351	16,732,989.57	1.04
61	000002	万科 A	2,022,886	16,729,267.22	1.04
62	000157	中联重科	3,773,293	16,715,687.99	1.04
63	000100	TCL 集团	7,327,465	16,706,620.20	1.04
64	600018	上港集团	3,748,029	16,678,729.05	1.04
65	601318	中国平安	422,976	16,639,875.84	1.03
66	600031	三一重工	3,297,969	16,621,763.76	1.03
67	601688	华泰证券	2,200,877	16,550,595.04	1.03
68	601901	方正证券	3,047,920	16,550,205.60	1.03
69	600010	包钢股份	4,561,892	16,514,049.04	1.03
70	000776	广发证券	1,684,148	16,504,650.40	1.03
71	300104	乐视网	375,018	16,463,290.20	1.02
72	600256	广汇能源	2,344,497	16,458,368.94	1.02
73	600518	康美药业	1,097,440	16,406,728.00	1.02
74	000538	云南白药	312,587	16,317,041.40	1.01
75	600585	海螺水泥	1,033,434	16,245,582.48	1.01
76	600048	保利地产	3,266,212	16,200,411.52	1.01
77	600332	白云山	647,954	16,127,575.06	1.00
78	601668	中国建筑	5,673,749	15,999,972.18	0.99
79	601628	中国人寿	1,175,094	15,993,029.34	0.99
80	601117	中国化学	3,069,090	15,989,958.90	0.99
81	600000	浦发银行	1,760,306	15,930,769.30	0.99
82	002304	洋河股份	313,127	15,891,195.25	0.99
83	000069	华侨城 A	3,384,478	15,873,201.82	0.99
84	601006	大秦铁路	2,513,547	15,860,481.57	0.99
85	600637	百视通	488,835	15,657,385.05	0.97
86	601398	工商银行	4,584,859	15,542,672.01	0.97
87	000402	金融街	2,845,074	15,505,653.30	0.96
88	000024	招商地产	1,480,933	15,431,321.86	0.96
89	002024	苏宁云商	2,229,877	14,627,993.12	0.91

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	002230	科大讯飞	19,291,044.98	1.01
2	300027	华谊兄弟	18,178,884.39	0.95
3	300104	乐视网	17,962,018.02	0.94
4	601118	海南橡胶	17,406,332.60	0.91
5	000581	威孚高科	17,335,466.78	0.91
6	600703	三安光电	17,322,439.25	0.91
7	600196	复星医药	17,272,436.33	0.90
8	600089	特变电工	17,117,369.94	0.90
9	601989	中国重工	5,191,809.51	0.27
10	002236	大华股份	5,036,842.90	0.26
11	601117	中国化学	4,465,351.62	0.23
12	000983	西山煤电	4,120,376.09	0.22
13	000725	京东方 A	3,918,528.00	0.21
14	600031	三一重工	3,332,214.00	0.17
15	000423	东阿阿胶	2,825,944.24	0.15
16	002241	歌尔声学	2,635,795.43	0.14
17	600111	包钢稀土	2,522,690.62	0.13
18	000001	平安银行	2,486,962.35	0.13
19	000568	泸州老窖	2,466,540.85	0.13
20	000776	广发证券	2,406,724.98	0.13

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	600549	厦门钨业	19,601,860.66	1.03
2	601899	紫金矿业	18,855,668.59	0.99
3	000869	张裕A	17,951,086.31	0.94
4	000630	铜陵有色	17,833,946.31	0.93
5	000425	徐工机械	17,709,414.10	0.93
6	600489	中金黄金	17,640,519.93	0.92
7	600362	江西铜业	16,700,428.53	0.88
8	000937	冀中能源	14,447,876.60	0.76
9	601699	潞安环能	13,487,814.94	0.71
10	600383	金地集团	11,240,534.95	0.59
11	002304	洋河股份	9,341,974.63	0.49
12	002594	比亚迪	8,811,463.93	0.46
13	000725	京东方A	7,892,275.86	0.41
14	000402	金融街	6,733,380.22	0.35
15	600519	贵州茅台	6,527,922.67	0.34
16	600028	中国石化	4,596,403.96	0.24
17	000858	五粮液	4,412,671.62	0.23
18	601169	北京银行	4,170,471.21	0.22
19	600015	华夏银行	3,950,609.54	0.21
20	000001	平安银行	3,865,203.96	0.20

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	221,433,794.07
卖出股票收入（成交）总额	360,144,854.52

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,166.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,541.84
5	应收申购款	2,575.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,284.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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	000562	宏源证券	18,624,974.64	1.16	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
银华金利	5,451	108,340.73	556,516,511.00	94.23%	34,048,826.00	5.77%
银华鑫利	18,634	31,692.89	37,880,121.00	6.41%	552,685,216.00	93.59%
银华 90	21,302	31,440.95	75,053,679.02	11.21%	594,701,470.42	88.79%
合计	45,387	40,780.09	669,450,311.02	36.17%	1,181,435,512.42	63.83%

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

银华金利

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	瑞士信贷（香港）有限公司	495,352,884.00	83.88%
2	中意人寿保险有限公司一分红一团体年金	39,761,133.00	6.73%
3	海南洋浦海悦药业有限公司	12,424,528.00	2.10%
4	红塔证券—华夏—红塔登峰 1 号集合资产管理计划	5,000,000.00	0.85%
5	株洲千金药业股份有限公司	2,434,000.00	0.41%
6	彩霞	1,231,751.00	0.21%
7	张柏岩	1,217,512.00	0.21%
8	上海卓邦资产管理有限公司	852,211.00	0.14%

9	张兵	842,644.00	0.14%
10	王辉	525,786.00	0.09%

银华鑫利

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	安信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	14,051,840.00	2.38%
2	海南洋浦海悦药业有限公司	8,743,400.00	1.48%
3	沈阳市蓝光自动化技术有限公司	6,417,607.00	1.09%
4	王炜锋	5,697,604.00	0.96%
5	王一敏	4,900,000.00	0.83%
6	曹凤兰	4,857,857.00	0.82%
7	华泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	4,497,869.00	0.76%
8	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	4,299,070.00	0.73%
9	海通证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	4,214,037.00	0.71%
10	王炜翔	4,026,001.00	0.68%

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	银华金利	-	-
	银华鑫利	-	-
	银华 90	33,086.14	0.00%
	合计	33,086.14	0.00%

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华金利	0
	银华鑫利	0
	银华 90	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华金利	0
	银华鑫利	0

	银华 90	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华金利	银华鑫利	银华 90
基金合同生效日(2011 年 3 月 17 日)	777,822,128.00	777,822,128.00	1,684,736,759.21
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	615,520,587.00	615,520,587.00	733,497,335.02
本报告期基金总申购份额	-	-	48,933,146.61
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	230,759,163.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-24,955,250.00	-24,955,250.00	118,083,831.35
本报告期期末基金份额总额	590,565,337.00	590,565,337.00	669,755,149.44

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定期份额折算中调整的份额。

§ 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

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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

本报告期内，本基金未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	
安信证券股份有限公司	3	228,798,070.83	39.34%	208,291.66	39.34%	-
太平洋证券股份有限公司	2	211,271,667.46	36.33%	192,342.17	36.33%	-
西南证券股份有限公司	1	30,107,105.80	5.18%	27,406.95	5.18%	-
江海证券有限公司	2	22,092,782.65	3.80%	20,111.53	3.80%	-
长江证券股份有限公司	2	20,382,055.25	3.50%	18,556.57	3.50%	-
民生证券有限责任公司	2	20,063,322.78	3.45%	18,264.43	3.45%	-
中信证券股份有限公司	3	13,364,446.37	2.30%	12,168.94	2.30%	-
国金证券股份有限公司	2	10,918,530.35	1.88%	9,941.08	1.88%	-
上海证券有限责任公司	1	8,571,787.53	1.47%	7,805.22	1.47%	-
华创证券有限责任公司	2	6,804,160.82	1.17%	6,193.95	1.17%	-
中国国际金融有限公司	2	5,490,405.91	0.94%	5,000.99	0.94%	-
德邦证券有限责任公司	1	3,714,312.84	0.64%	3,382.87	0.64%	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
日信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	3	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富里昂证券有限公司	1	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
华安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	撤销 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

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理有限公司 2013 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 2 日
2	《关于银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金之银华金利份额 2014 年度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	2014 年 1 月 3 日
3	《关于银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金之银华金利份额 2014 年度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	2014 年 1 月 3 日
4	《关于银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间银华金利份额停牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 3 日
5	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞银行费率优惠活动的更正公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 4 日
6	《关于银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 6 日
7	《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2013 年第四季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 21 日
8	《银华基金管理有限公司关于开通农业银行机构网上直销业务公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 2 月 17 日
9	《银华基金关于增加厦门银行为旗下部分基金代销、定投业务办理机构公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 2 月 19 日
10	《银华基金关于旗下部分基金参加光大证券手机客户端申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 15 日
11	《银华基金管理有限公司关于开展直销网上交易基金转换费率优惠的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 25 日
12	《关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金代销等业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 26 日
13	《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2013 年	三大证券报及本基	2014 年 3 月 28 日

	年度报告摘要》	金管理人网站	
14	《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2013 年年度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 28 日
15	《银华基金关于增加民族证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 1 日
16	《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 19 日
17	《银华中证等权重 90 指数分级基金更新招募说明书摘要（2014 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 30 日
18	《银华中证 90 指数分级基金更新招募说明书（2014 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 30 日
19	《银华基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 5 月 23 日
20	《银华基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 5 月 26 日
21	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 6 月 5 日
22	《关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 6 月 10 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2014 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

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。

银华基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日