

银华深证 100 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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 2015 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41

7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华深证 100 指数分级证券投资基金		
基金简称	银华深证 100 指数分级		
场内简称	100 分级		
基金主代码	161812		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 5 月 7 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,696,760,165.92 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	2010-06-07		
下属分级基金的基金简称	银华稳进	银华锐进	100 分级
下属分级基金的交易代码	150018	150019	161812
报告期末下属分级基金份额总额	2,043,727,577.00 份	2,043,727,577.00 份	609,305,011.92 份

注：本基金管理人于 2015 年 4 月 30 日发布公告，自 2015 年 5 月 4 日起将本基金的基础份额的场内简称由“银华 100”变更为“100 分级”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，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，以实现深证 100 指数的有效跟踪，分享中国经济的持续、稳定增长的成果，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，按照成份股在深证 100 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 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深证 100 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，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%）。</p>
业绩比较基准	95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税

	后)。		
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，银华稳进份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华锐进份额具有高风险、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		银华基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	赵天杰
	联系电话	(010)58163000	(010) 58560666
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhaotianjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95568
传真		(010)58163027	(010) 58560798
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100738	100031
法定代表人		王珠林	洪崎

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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,846,369,560.97
本期利润	3,294,729,127.13
加权平均基金份额本期利润	0.3982
本期加权平均净值利润率	36.63%
本期基金份额净值增长率	36.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,834,904,736.29
期末可供分配基金份额利润	0.3907
期末基金资产净值	5,824,947,824.06
期末基金份额净值	1.240
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.16%

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	-8.22%	3.41%	-7.63%	3.32%	-0.59%	0.09%
过去三个月	12.22%	2.56%	12.73%	2.51%	-0.51%	0.05%
过去六个月	36.41%	2.15%	37.83%	2.10%	-1.42%	0.05%
过去一年	92.33%	1.72%	94.49%	1.69%	-2.16%	0.03%
过去三年	63.80%	1.44%	65.30%	1.44%	-1.50%	0.00%
自基金合同生效起至今	46.16%	1.43%	45.06%	1.46%	1.10%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为 95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。由于本基金的投资标的为深证 100 价格指数，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 $95\% \times$ 深证 100 价格指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行活期存款利率（税后）。该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

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：投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，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%）。

§ 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 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 50 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、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。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职 日期	离任日期		
周毅 先生	本基金的 基金 经理、公司 副 总 经 理、境外 投 资 部 总 监、量化 投 资 部 总 监及量化 投 资 总 监。	2010 年 5 月 7 日	-	16 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，2010 年 6 月 21 日至 2011 年 12 月 6 日期间兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2010 年 8 月 5 日至 2012 年 3 月 27 日期间兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，2010 年 12 月 6 日至 2012 年 11 月 7 日期间兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：美国。

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、《银华深证 100 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 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。尽管报告期间本基金多次发生大额申购赎回，我们仍将跟踪误差控制在合理水平。

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 1.240 元，本报告期份额净值增长率为 36.41%，同期业绩比较基准收益率为 37.83%。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

2015 年上半年 A 股市场先单边上涨，后单边下跌，6 月中旬之前延续五个多月的单边上涨行情，之后开始近乎断崖式的下跌，沪深 300 指数涨 26.58%，深证 100 指数涨 39.96%。尤其在 6 月中下旬的急速下跌中，深证 100 指数作为配置均衡的中盘蓝筹股指数体现了极好的抗跌性，大幅跑赢沪深 300。

展望 2015 年下半年，通胀虽仍处于低位，但在原油和猪肉价格止跌推动下，已有企稳改善迹

象，货币政策宽松趋势不改，政府仍将以“宽货币+宽财政”为经济托底，启动大规模稳增长和稳房市政策，除了重大投资、消费工程和一带一路、京津冀协同发展等战略。在上半年经济继续低迷的状态下，下半年经济企稳的预期依然无法预见，但房地产在宽松货币政策下会有所企稳，事实上，也正在实现软着陆的过程。具体来看，大中城市商品房销售继续回复，价格略有回升，周期性销售恢复与政府稳定房地产市场的政策合并对房地产销售回暖有积极影响。现在地产行业处于基本面高点股价低点，行业的周期景气下行已经在股价上有所体现。短期看板块估值很低，政策一直保持稳定地产的态势，降息降准的货币政策已经相当宽松，基本面基本企稳企稳，看好估值低有安全边际，会有相对收益，同时涉及国家重大区域战略，如京津冀一体化的个股将会有超越板块的收益。电子计算机互联网等行业成为目前提高经济效率的润滑剂，新的经济增长点，个股在经历了大幅杀跌之后，板块估值趋于合理，依旧看好为新经济的驱动力。医药板块作为防御板块，是长久的配置板块。

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，本基金（包括 100 分级份额、银华稳进份额、银华锐进份额）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

中国民生银行根据《银华深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和《银华深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》，托管银华深证 100 指数分级证券投资基金（以下简称“银华深证 100 指数分级”）。

本报告期，中国民生银行在银华深证 100 指数分级的托管过程中，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，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——银华基金管理有限公司在银华深证 100 指数分级投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，基金管理人——银华基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

根据本基金基金合同的约定，本基金（包括 100 分级份额、银华稳进份额、银华锐进份额）不进行收益分配。

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

由银华深证 100 指数分级的基金管理人——银华基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：银华深证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资产:			
银行存款	6.4.7.1	328,598,976.31	839,925,888.54
结算备付金		-	34,414.15
存出保证金		9,062,985.38	7,709,368.28
交易性金融资产	6.4.7.2	5,310,930,627.07	10,536,567,961.37
其中: 股票投资		5,310,930,627.07	10,536,567,961.37
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		-	304,595,306.05
应收利息	6.4.7.5	107,233.06	287,952.65
应收股利		-	-
应收申购款		200,827,841.51	88,830.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,849,527,663.33	11,689,209,721.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		12,028,379.22	532,131,029.73
应付管理人报酬		5,402,302.59	12,834,708.34
应付托管费		1,080,460.52	2,566,941.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,567,723.20	11,455,497.69
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	500,973.74	2,349,996.08
负债合计		24,579,839.27	561,338,173.54
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,990,043,087.77	10,388,371,977.84
未分配利润	6.4.7.10	1,834,904,736.29	739,499,570.05
所有者权益合计		5,824,947,824.06	11,127,871,547.89
负债和所有者权益总计		5,849,527,663.33	11,689,209,721.43

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，100 分级份额净值为人民币 1.240 元，银华稳进份额净值为人民币 1.028 元，银华锐进份额净值为人民币 1.452 元；基金份额总额为 4,696,760,165.92 份，其中 100 分级份额为 609,305,011.92 份，银华稳进份额为 2,043,727,577.00 份，银华锐进份额为 2,043,727,577.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华深证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		3,367,952,675.14	-878,264,113.48
1.利息收入		2,530,721.05	5,680,535.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,530,721.05	5,680,535.25
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）		3,904,575,901.42	-469,588,861.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,873,542,414.26	-647,065,822.88
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	31,033,487.16	177,476,960.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-551,640,433.84	-421,310,206.56
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	12,486,486.51	6,954,419.73
减：二、费用		73,223,548.01	116,327,699.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	44,804,003.89	79,384,334.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,960,800.82	15,876,866.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	19,211,960.41	20,828,440.69
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	246,782.89	238,057.99

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,294,729,127.13	-994,591,813.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,294,729,127.13	-994,591,813.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华深证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	10,388,371,977.84	739,499,570.05	11,127,871,547.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,294,729,127.13	3,294,729,127.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,398,328,890.07	-2,199,323,960.89	-8,597,652,850.96
其中：1.基金申购款	1,277,625,720.58	401,911,221.41	1,679,536,941.99
2.基金赎回款	-7,675,954,610.65	-2,601,235,182.30	-10,277,189,792.95
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）	3,990,043,087.77	1,834,904,736.29	5,824,947,824.06
项目	上年度可比期间 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）	21,416,204,118.50	-3,913,813,763.35	17,502,390,355.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-994,591,813.13	-994,591,813.13
三、本期基金份额交易产	55,808,962.56	-237,494,008.48	-181,685,045.92

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	7,242,447,529.61	-1,829,925,964.52	5,412,521,565.09
2.基金赎回款	-7,186,638,567.05	1,592,431,956.04	-5,594,206,611.01
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)	21,472,013,081.06	-5,145,899,584.96	16,326,113,496.10

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：

<u>王立新</u>	<u>杨清</u>	<u>龚飒</u>
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

银华深证 100 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]302 号文《关于核准银华深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》的核准,由银华基金管理有限公司于 2010 年 4 月 1 日至 2010 年 4 月 30 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2010)验字第 60468687_A01 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2010 年 5 月 7 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 2,203,273,458.85 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 614,907.10 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 2,203,888,365.95 元,折合 2,203,888,365.95 份基金份额。根据《基金合同》的约定,场外认购的全部份额确认为 100 分级份额;场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为银华锐进份额和银华稳进份额。其中场外认购的基金份额确认为 1,748,978,674.95 份 100 分级份额(含募集期利息结转的份额);场内认购的基金份额按 1:1 的比例确认为 227,454,845.00 份银华锐进份额和 227,454,845.00 份银华稳进份额,产生的尾差份额 1.00 份根据《基金合同》约定归入基金资产。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华深证 100 指数分级证券投资基金之基础份额(简称“100 分级份额”)、银华深证 100 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“银华稳进份额”)与银华深证 100 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“银华锐进份额”)。其中,银华稳进份

额、银华锐进份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

在银华稳进份额、100 分级份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。银华稳进份额和银华锐进份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对银华稳进份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份 100 分级份额将按 1 份银华稳进份额获得约定应得收益的新增折算份额。对于银华稳进份额期末的约定应得收益，即银华稳进份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内 100 分级份额分配给银华稳进份额持有人。100 分级份额持有人持有的每 2 份 100 分级份额将按 1 份银华稳进份额获得新增 100 分级份额的分配。持有场外 100 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 100 分级份额的分配；持有场内 100 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 100 分级份额的分配。经过上述份额折算，银华稳进份额和 100 分级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，本基金将对银华稳进份额和 100 分级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 100 分级份额的基金份额净值达到 2.000 元；当银华锐进份额的基金份额净值达到 0.250 元。当 100 分级份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对银华稳进份额、银华锐进份额和 100 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华稳进份额和银华锐进份额的比例为 1:1，份额折算后银华稳进份额、银华锐进份额和 100 分级份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当银华锐进份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对银华稳进份额、银华锐进份额和 100 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银华稳进份额和银华锐进份额的比例为 1:1，份额折算后 100 分级份额、银华稳进份额和银华锐进份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

100 分级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。银华稳进份额与银华锐进份额交易代码不同，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，包括深证 100 指数的成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-10%（其中权证资产占基金资产比例为 0-3%，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%）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，

基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 深证 100 价格指数收益率 $+ 5\% \times$ 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《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年度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

除 6.4.5.2 会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外，本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发[2014]24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 25 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

6.4.6.2 营业税、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，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

6.4.6.3 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	328,598,976.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	328,598,976.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,121,677,901.18	5,310,930,627.07	2,189,252,725.89

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	3,121,677,901.18	5,310,930,627.07	2,189,252,725.89

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	103,153.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.52
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4,078.30
合计	107,233.06

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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,567,723.20
银行间市场应付交易费用	-

合计	5,567,723.20
----	--------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,538.93
预提费用	328,107.06
应付其他	152,327.75
合计	500,973.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,850,773,872.21	10,388,371,977.84
本期申购	38,563.51	33,804.72
本期赎回(以“-”号填列)	-239,415,944.97	-209,871,782.63
2015 年 1 月 5 日 基金拆分/份额折算前	11,611,396,490.75	10,178,533,999.93
基金拆分/份额折算变动份额	369,910,561.71	-
本期申购	1,503,734,375.35	1,277,591,915.86
本期赎回(以“-”号填列)	-8,788,281,261.89	-7,466,082,828.02
本期末	4,696,760,165.92	3,990,043,087.77

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 2015 年 1 月 5 日为份额折算基准日，对 100 分级份额的场外份额、场内份额以及银华稳进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 100 分级份额，银华稳进份额和银华锐进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稳进份额和银华锐进份额的情况。

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	286,005,976.70	453,493,593.35	739,499,570.05

本期利润	3,846,369,560.97	-551,640,433.84	3,294,729,127.13
本期基金份额交易产生的变动数	-1,447,363,474.73	-751,960,486.16	-2,199,323,960.89
其中：基金申购款	380,586,632.93	21,324,588.48	401,911,221.41
基金赎回款	-1,827,950,107.66	-773,285,074.64	-2,601,235,182.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,685,012,062.94	-850,107,326.65	1,834,904,736.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	2,416,492.04
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	7,754.88
其他	106,474.13
合计	2,530,721.05

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	9,690,079,415.98
减：卖出股票成本总额	5,816,537,001.72
买卖股票差价收入	3,873,542,414.26

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	31,033,487.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,033,487.16

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-551,640,433.84
——股票投资	-551,640,433.84
——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	-551,640,433.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,486,486.51
合计	12,486,486.51

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	19,211,960.41

银行间市场交易费用	-
合计	19,211,960.41

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行费用	470.83
账户服务费	18,000.00
上市费	29,752.78
其他	205.00
合计	246,782.89

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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	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

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交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,804,003.89	79,384,334.10
其中：支付销售机构的客户维护费	657,549.72	719,849.49

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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,960,800.82	15,876,866.87

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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及上年度可比期间均未运用固有资金投资银华稳进、银华锐进、100 分级基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

银华稳进				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
西南证券	-	-	22,600,094.00	0.42%

份额单位：份

银华锐进				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
西南证券	-	-	22,600,016.00	0.42%

份额单位：份

100 分级				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
西南证券	-	-	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末持有银华稳进、银华锐进、100 分级基金份额。除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国民生银行	328,598,976.31	2,416,492.04	1,241,752,740.79	5,497,696.39

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通过关联方购买其承销的证券。

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 100 分级份额、银华稳进份额、银华锐进份额）不进行收益分配。

6.4.12 期末（2015 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
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大事项	36.50	-	-	4,081,058	56,875,374.23	148,958,617.00	-
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项	30.81	-	-	2,429,766	35,799,717.32	74,861,090.46	-
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项	10.32	-	-	5,698,270	38,612,304.67	58,806,146.40	-
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	重大事项	7.00	2015 年 8 月 24 日	6.30	7,204,516	18,998,061.78	50,431,612.00	-
000778	新兴铸管	2015 年 6 月 15 日	重大事项	12.96	-	-	3,828,660	15,617,762.54	49,619,433.60	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项	16.89	-	-	2,544,371	26,051,480.38	42,974,426.19	-
000839	中信	2015	重大	23.57	-	-	1,731,151	13,975,152.22	40,803,229.07	-

	国安	2015年6月29日	事项								
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大事项	37.29	-	-	890,434	15,637,705.38	33,204,283.86	-	
002106	莱宝高科	2015年4月7日	重大事项	16.42	-	-	1,837,809	29,239,488.46	30,176,823.78	-	
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	35.04	-	-	847,456	38,493,227.27	29,694,858.24	-	
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	-	-	1,550,705	19,334,245.24	28,734,563.65	-	
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	71.48	2015年8月5日	69.20	369,382	19,658,459.69	26,403,425.36	-	
002001	新和成	2015年6月30日	重大事项	17.09	2015年7月13日	18.49	900,053	12,224,598.18	15,381,905.77	-	
002069	獐子岛	2015年5月30日	重大事项	19.76	-	-	565,549	8,963,508.44	11,175,248.24	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以	不计息	合计
-----	--------	--------	------	-------	------	-----	----

2015年6月30日		月	-1年		上		
资产							
银行存款	328,598,976.31	-	-	-	-	-	328,598,976.31
存出保证金	9,062,985.38	-	-	-	-	-	9,062,985.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,310,930,627.07	5,310,930,627.07
应收利息	-	-	-	-	-	107,233.06	107,233.06
应收申购款	1,092.74	-	-	-	-	200,826,748.77	200,827,841.51
资产总计	337,663,054.43	-	-	-	-	5,511,864,608.90	5,849,527,663.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,028,379.22	12,028,379.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,402,302.59	5,402,302.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,080,460.52	1,080,460.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,567,723.20	5,567,723.20
其他负债	-	-	-	-	-	500,973.74	500,973.74
负债总计	-	-	-	-	-	24,579,839.27	24,579,839.27
利率敏感度缺口	337,663,054.43	-	-	-	-	5,487,284,769.63	5,824,947,824.06
上年度末 2014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	839,925,888.54	-	-	-	-	-	839,925,888.54
结算备付金	34,414.15	-	-	-	-	-	34,414.15
存出保证金	7,709,368.28	-	-	-	-	-	7,709,368.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	10,536,567,961.37	10,536,567,961.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	304,595,306.05	304,595,306.05
应收利息	-	-	-	-	-	287,952.65	287,952.65
应收申购款	298.20	-	-	-	-	88,532.19	88,830.39
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	847,669,969.17	-	-	-	-	10,841,539,752.26	11,689,209,721.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	532,131,029.73	532,131,029.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,834,708.34	12,834,708.34
应付托管费	-	-	-	-	-	2,566,941.70	2,566,941.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,455,497.69	11,455,497.69
其他负债	-	-	-	-	-	2,349,996.08	2,349,996.08
负债总计	-	-	-	-	-	561,338,173.54	561,338,173.54
利率敏感度缺口	847,669,969.17	-	-	-	-	10,280,201,578.72	11,127,871,547.89

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，并按照合同约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 2015 年 6 月 30 日及 2014 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,包括深证 100 指数的成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%,其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%(其中权证资产占基金资产比例为 0—3%,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%)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。于 2015 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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	5,310,930,627.07	91.18	10,536,567,961.37	94.69
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	5,310,930,627.07	91.18	10,536,567,961.37	94.69

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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+5%	295,767,009.82	548,294,616.20
	-5%	-295,767,009.82	-548,294,616.20

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	5,310,930,627.07	90.79
	其中：股票	5,310,930,627.07	90.79
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	328,598,976.31	5.62
7	其他各项资产	209,998,059.95	3.59
8	合计	5,849,527,663.33	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	11,175,248.24	0.19
B	采矿业	78,277,114.92	1.34
C	制造业	2,984,311,322.61	51.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,326,531.71	0.55
E	建筑业	43,805,427.65	0.75
F	批发和零售业	139,972,158.26	2.40
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	421,650,423.15	7.24
J	金融业	712,444,227.88	12.23
K	房地产业	479,476,820.70	8.23
L	租赁和商务服务业	80,450,502.75	1.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	164,113,397.31	2.82
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	99,679,261.89	1.71
S	综合	37,604,906.85	0.65
	合计	5,285,287,343.92	90.74

7.2.2 期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	25,643,283.15	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,643,283.15	0.44

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	000651	格力电器	4,230,417	270,323,646.30	4.64
2	000002	万科A	15,698,525	227,942,583.00	3.91
3	000001	平安银行	11,643,707	169,299,499.78	2.91
4	000024	招商地产	4,081,058	148,958,617.00	2.56
5	000333	美的集团	3,782,420	141,008,617.60	2.42
6	000783	长江证券	9,327,389	130,117,076.55	2.23
7	000776	广发证券	5,353,638	121,259,900.70	2.08
8	002024	苏宁云商	7,422,793	113,568,732.90	1.95
9	002415	海康威视	2,427,984	108,773,683.20	1.87
10	000166	申万宏源	6,363,747	103,410,888.75	1.78
11	000858	五粮液	3,257,690	103,268,773.00	1.77
12	000768	中航飞机	2,079,771	90,636,420.18	1.56
13	000725	京东方A	17,378,228	90,193,003.32	1.55
14	000063	中兴通讯	3,400,805	80,973,167.05	1.39
15	000625	长安汽车	3,788,139	80,119,139.85	1.38
16	000069	华侨城A	6,080,073	78,919,347.54	1.35
17	000100	TCL 集团	13,949,642	78,815,477.30	1.35
18	300104	乐视网	1,459,269	75,531,763.44	1.30
19	000917	电广传媒	2,429,766	74,861,090.46	1.29
20	000728	国元证券	1,896,625	72,033,817.50	1.24
21	300024	机器人	891,490	68,876,517.40	1.18
22	000338	潍柴动力	2,045,634	64,764,772.44	1.11

23	000538	云南白药	748,884	64,606,222.68	1.11
24	002450	康得新	2,110,354	64,576,832.40	1.11
25	000157	中联重科	7,635,350	61,922,688.50	1.06
26	000630	铜陵有色	5,698,270	58,806,146.40	1.01
27	300027	华谊兄弟	1,486,755	56,704,835.70	0.97
28	002202	金风科技	2,881,854	56,109,697.38	0.96
29	002594	比亚迪	993,024	54,844,715.52	0.94
30	000423	东阿阿胶	982,617	53,552,626.50	0.92
31	002230	科大讯飞	1,510,555	52,778,791.70	0.91
32	000039	中集集团	1,566,575	50,600,372.50	0.87
33	000709	河北钢铁	7,204,516	50,431,612.00	0.87
34	300070	碧水源	1,024,844	50,002,138.76	0.86
35	000778	新兴铸管	3,828,660	49,619,433.60	0.85
36	002405	四维图新	1,126,468	49,339,298.40	0.85
37	002142	宁波银行	2,279,992	48,221,830.80	0.83
38	002241	歌尔声学	1,334,883	47,922,299.70	0.82
39	000559	万向钱潮	2,170,693	47,451,348.98	0.81
40	002304	洋河股份	674,106	46,755,992.16	0.80
41	000402	金融街	3,256,900	46,019,997.00	0.79
42	000060	中金岭南	2,394,550	44,514,684.50	0.76
43	002465	海格通信	1,380,923	44,451,911.37	0.76
44	000623	吉林敖东	1,320,914	44,382,710.40	0.76
45	002081	金螳螂	1,553,935	43,805,427.65	0.75
46	000793	华闻传媒	2,544,371	42,974,426.19	0.74
47	002008	大族激光	1,492,911	42,876,403.92	0.74
48	000568	泸州老窖	1,273,774	41,537,770.14	0.71
49	002065	东华软件	1,434,552	41,243,370.00	0.71
50	000839	中信国安	1,731,151	40,803,229.07	0.70
51	002456	欧菲光	1,130,162	38,131,665.88	0.65
52	000425	徐工机械	2,859,773	37,949,187.71	0.65
53	300017	网宿科技	813,109	37,744,519.78	0.65
54	000009	中国宝安	2,305,635	37,604,906.85	0.65
55	000629	攀钢钒钛	6,938,649	37,191,158.64	0.64
56	000800	一汽轿车	1,492,598	37,135,838.24	0.64
57	000895	双汇发展	1,725,067	36,795,679.11	0.63
58	000826	桑德环境	904,909	35,191,911.01	0.60
59	000750	国海证券	2,088,962	35,094,561.60	0.60
60	000876	新希望	1,792,823	34,798,694.43	0.60
61	300124	汇川技术	708,301	33,998,448.00	0.58

62	002030	达安基因	753,112	33,362,861.60	0.57
63	002292	奥飞动漫	890,434	33,204,283.86	0.57
64	002500	山西证券	1,824,580	33,006,652.20	0.57
65	300058	蓝色光标	2,080,797	32,897,400.57	0.56
66	000598	兴蓉投资	3,377,903	32,326,531.71	0.55
67	000581	威孚高科	1,033,057	32,014,436.43	0.55
68	000792	盐湖股份	1,125,769	31,949,324.22	0.55
69	002236	大华股份	992,467	31,679,546.64	0.54
70	000970	中科三环	1,524,447	31,418,852.67	0.54
71	000061	农产品	1,509,109	30,785,823.60	0.53
72	002106	莱宝高科	1,837,809	30,176,823.78	0.52
73	002353	杰瑞股份	847,456	29,694,858.24	0.51
74	000046	泛海控股	2,022,918	29,635,748.70	0.51
75	002385	大北农	2,171,615	29,360,234.80	0.50
76	000400	许继电气	1,162,136	29,239,341.76	0.50
77	000012	南玻A	2,170,522	28,954,763.48	0.50
78	000878	云南铜业	1,550,705	28,734,563.65	0.49
79	002475	立讯精密	838,628	28,354,012.68	0.49
80	000825	太钢不锈	3,983,419	28,322,109.09	0.49
81	002038	双鹭药业	498,735	28,253,337.75	0.49
82	000831	五矿稀土	1,071,580	27,411,016.40	0.47
83	300002	神州泰岳	1,797,960	27,400,910.40	0.47
84	002146	荣盛发展	2,153,590	26,919,875.00	0.46
85	000983	西山煤电	2,810,253	26,641,198.44	0.46
86	000963	华东医药	369,382	26,403,425.36	0.45
87	000960	锡业股份	1,308,408	26,364,421.20	0.45
88	002073	软控股份	1,139,111	26,313,464.10	0.45
89	002007	华兰生物	564,440	24,999,047.60	0.43
90	000729	燕京啤酒	2,245,206	23,350,142.40	0.40
91	002422	科伦药业	559,030	22,383,561.20	0.38
92	300315	掌趣科技	1,619,738	21,947,449.90	0.38
93	000999	华润三九	694,594	21,108,711.66	0.36
94	002570	贝因美	1,069,217	20,753,501.97	0.36
95	002344	海宁皮城	854,166	16,767,278.58	0.29
96	002001	新和成	900,053	15,381,905.77	0.26
97	000937	冀中能源	1,801,092	14,444,757.84	0.25
98	002069	獐子岛	565,549	11,175,248.24	0.19

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	000977	浪潮信息	867,793	25,643,283.15	0.44

注：本基金本报告期末仅持有上述积极投资股票。

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	000166	申万宏源	531,237,982.47	4.77
2	000977	浪潮信息	57,506,561.55	0.52
3	000425	徐工机械	29,522,697.45	0.27
4	000651	格力电器	27,412,277.34	0.25
5	000002	万科 A	27,325,297.51	0.25
6	000783	长江证券	20,629,494.70	0.19
7	000001	平安银行	19,762,196.14	0.18
8	000776	广发证券	16,506,537.27	0.15
9	000333	美的集团	13,567,466.49	0.12
10	000858	五粮液	11,202,317.87	0.10
11	002415	海康威视	11,149,014.54	0.10
12	002024	苏宁云商	10,436,301.48	0.09
13	000725	京东方 A	9,640,065.00	0.09
14	000063	中兴通讯	9,631,162.64	0.09
15	000768	中航飞机	9,268,379.93	0.08
16	000100	TCL 集团	9,217,198.00	0.08
17	000625	长安汽车	8,033,024.66	0.07
18	000338	潍柴动力	7,665,645.47	0.07
19	002450	康得新	7,290,389.94	0.07
20	000728	国元证券	7,283,460.00	0.07

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	000166	申万宏源	443,153,317.38	3.98
2	000002	万 科 A	413,565,358.73	3.72
3	000651	格力电器	386,660,133.54	3.47
4	000001	平安银行	321,266,731.43	2.89
5	000776	广发证券	271,372,379.32	2.44
6	000783	长江证券	269,657,975.83	2.42
7	000333	美的集团	240,574,564.53	2.16
8	002024	苏宁云商	198,962,641.21	1.79
9	000063	中兴通讯	163,973,603.21	1.47
10	000625	长安汽车	162,570,957.37	1.46
11	000858	五 粮 液	154,600,205.09	1.39
12	002415	海康威视	150,941,529.38	1.36
13	000100	TCL 集团	150,218,636.01	1.35
14	000725	京东方 A	135,218,314.20	1.22
15	300104	乐视网	127,414,699.84	1.15
16	300315	掌趣科技	127,315,451.28	1.14
17	000728	国元证券	123,942,274.11	1.11
18	000338	潍柴动力	119,854,475.93	1.08
19	000768	中航飞机	118,596,022.11	1.07
20	002450	康得新	114,927,375.26	1.03

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	1,142,540,101.26
卖出股票收入（成交）总额	9,690,079,415.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,062,985.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	107,233.06
5	应收申购款	200,827,841.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,998,059.95

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	000024	招商地产	148,958,617.00	2.56	重大事项

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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
银华稳进	5,315	384,520.71	1,661,009,313.00	81.27%	382,718,264.00	18.73%
银华锐进	51,420	39,745.77	237,338,403.00	11.61%	1,806,389,174.00	88.39%
100 分级	13,761	44,277.67	275,157,861.97	45.16%	334,147,149.95	54.84%
合计	70,496	66,624.49	2,173,505,577.97	46.28%	2,523,254,587.95	53.72%

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

银华稳进

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

1	新华人寿保险股份有限公司	447,901,182.00	21.92%
2	天平汽车保险股份有限公司—自有资金	381,517,368.00	18.67%
3	工银安盛人寿保险有限公司	249,875,008.00	12.23%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	159,840,354.00	7.82%
5	中国人寿保险股份有限公司	89,207,158.00	4.36%
6	华宝投资有限公司	50,000,000.00	2.45%
7	程馨娴	49,775,749.00	2.44%
8	中荷人寿保险有限公司	47,502,131.00	2.32%
9	华夏资本—工商银行—中国工商银行股份有限公司	38,933,519.00	1.91%
10	中国对外经济贸易信托有限公司—光大稳健 1 号信托计划	30,482,310.00	1.49%

银华锐进

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	平安信托有限责任公司—金英汇集合资金信托	100,000,059.00	4.89%
2	程馨娴	49,775,749.00	2.44%
3	李刚	49,500,000.00	2.42%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	37,708,274.00	1.85%
5	广发证券—招行—广发增强型基金优选集合资产管理计划	31,631,702.00	1.55%
6	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	23,153,880.00	1.13%
7	招商证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	21,030,438.00	1.03%
8	丁香	18,000,000.00	0.88%
9	中国人寿再保险股份有限公司	17,883,823.00	0.88%
10	华泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	16,994,353.00	0.83%

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	银华稳进	—	—
	银华锐进	300.00	0.00%
	100 分级	312,944.04	0.05%
	合计	313,244.04	0.01%

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	银华稳进	0
	银华锐进	0
	100 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华稳进	0
	银华锐进	0
	100 分级	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳进	银华锐进	100 分级
基金合同生效日(2010 年 5 月 7 日) 基金份额总额	227,454,845.00	227,454,845.00	1,748,978,674.95
本报告期期初基金份额总额	5,381,151,394.00	5,381,151,394.00	1,088,471,084.21
本报告期基金总申购份额	-	-	1,503,772,938.86
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	9,027,697,206.86
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-3,337,423,817.00	-3,337,423,817.00	7,044,758,195.71
本报告期末基金份额总额	2,043,727,577.00	2,043,727,577.00	609,305,011.92

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

§ 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

本基金管理人于 2015 年 6 月 10 日发布公告，凌宇翔先生自 2015 年 6 月 8 日起担任本基金管理人副总经理，代为履行督察长职务。

本基金管理人于 2015 年 7 月 25 日发布公告，自 2015 年 7 月 24 日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长，凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为其审计的会计事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或者处罚。

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	
万和证券有限责任公司	1	3,714,260,949.52	37.93%	3,381,466.88	37.93%	新增一个交易单元
海通证券股份有限公司	1	3,197,628,555.47	32.66%	2,911,127.45	32.66%	-

中信证券（浙江）有限责任公司	1	1,646,347,800.16	16.81%	1,498,833.78	16.81%	-
万联证券有限责任公司	2	825,605,667.05	8.43%	751,630.58	8.43%	-
信达证券股份有限公司	1	192,870,007.06	1.97%	175,588.65	1.97%	-
中银国际证券有限责任公司	1	168,059,106.35	1.72%	153,001.46	1.72%	-
光大证券股份有限公司	1	47,293,863.37	0.48%	43,056.01	0.48%	-
浙商证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华林证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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	《银华基金管理有限公司 2014 年	三大证券报及本基	2015 年 1 月 5 日

	12 月 31 日基金净值公告》	金管理人网站	
2	《关于银华深证 100 指数分级证券投资基金之银华稳进份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
3	《关于银华深证 100 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间银华稳进份额停牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
4	《关于银华稳进定期份额折算后复牌首日收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 7 日
5	《关于银华深证 100 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	2015 年 1 月 7 日
6	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的掌趣科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 14 日
7	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 20 日
8	《银华基金管理有限公司关于增加深圳众禄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	2015 年 1 月 29 日
9	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华侨城 A 估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 9 日
10	《银华基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
11	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大北农估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 5 日
12	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 6 日
13	《关于增加上海好买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	2015 年 3 月 10 日
14	《关于增加杭州数米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	2015 年 3 月 13 日
15	《关于旗下部分基金持有的长安汽车、高新兴、中天科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
16	《银华基金管理有限公司关于增加太平洋证券为旗下部分基金代	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 25 日

	销机构的公告》		
17	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 3 月 28 日
18	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 3 月 28 日
19	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的阳光电源、美克家居、铜陵有色、安泰科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 3 日
20	《银华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行作为旗下部分基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 9 日
21	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中环股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 18 日
22	《银华深证 100 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 22 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东华软件估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 25 日
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 29 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分指数型证券投资基金变更场内简称的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 4 月 30 日
26	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的招商地产估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 5 月 15 日
27	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金螳螂、正泰电器、亿帆鑫富、国睿科技、多氟多、深科技、高德红外、长信科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 5 月 23 日
28	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金浦钛业、奥飞动漫、中炬高新、航天电子、中源协和、奥瑞金估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 5 月 27 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的宁波韵升、银星能源、探路者、天壕节能、四维图新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 4 日

30	《银华基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下部分基金代销及转换业务》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
31	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
32	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华闻传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 12 日
33	《银华深证 100 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
34	《银华深证 100 指数分级证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
35	《关于旗下部分基金持有的常山药业、国金证券、金亚科技、云南铜业、大立科技、信质电机估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
36	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 26 日
37	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的茂业物流、电广传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 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深证 100 指数分级证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华深证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华深证 100 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
2015 年 8 月 26 日