

银华深证100指数分级证券投资基金

2013半年度报告摘要

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
重要提示:基金管理人承诺,前经中国证监会核准,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。

在报告期内,我们运用自行开发的量化投资管理模型,采用系统管理和人工管理相结合的方式

根据法律法规为财务报表的重要组成部分。
本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金投资组合. Includes details like 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期, 基金上市日期, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期, 基金上市日期.

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至报告期末,本基金份额净值为0.708元,本报告期份额净值增长率为-9.81%,同期业绩比较基准收益率为-9.87%。报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

6.1 资产负债表
6.2 利润表
6.3 现金流量表
6.4 所有者权益变动表
6.5 报表附注

2.2 基金产品说明
本基金采用指数化投资方式,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,中短期跟踪误差控制在4%以内,以实现对标深证100指数的有效跟踪,分享中国经济的持续、稳定增长的成绩,实现基金资产的长期增值。

6.6 基金份额持有人服务
6.7 基金管理人承诺
6.8 基金托管人承诺
6.9 基金份额持有人服务
6.10 基金管理人承诺

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 当期发生的基金应支付的管理费, 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的审计费.

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 2 columns: 资产, 负债. Includes 银行存款, 交易性金融资产, 应收利息, 其他资产, 应付账款, 其他负债.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 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

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

3.2 主要财务指标和基金净值表现
3.2.1 基金净值表现
3.2.2 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人
4.1.2 基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

4.2 基金经理
4.2.1 基金经理
4.2.2 基金经理

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人
4.3.2 基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人
4.4.2 基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Includes 资产, 负债, 所有者权益, 未分配利润, 所有者权益合计, 未分配利润, 所有者权益合计.

Table with 2 columns: 项目, 金额. Includes 1 权益类资产, 2 固定收益类资产, 3 金融衍生品, 4 其他资产, 5 其他负债, 6 其他资产, 7 其他负债.

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 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(%)

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

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

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

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