

信息披露 Disclosure

银华沪深300指数证券投资基金(LOF)

[2013] 第四季度报告

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
报告日期:2014年1月21日

§ 重要提示

基金管理人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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

§ 1 报告期内财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 银华沪深300指数(LOF)(场内简称:银华300)

交易代码 161811

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2009年10月14日

报告期末基金份额总额 346,343,221.57份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,62,547.03

2.本期利润 -10,526,103.95

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0267

4.期末基金份额净值 250,377,464.17

(0.723)

5.期末可供分配基金份额净值 236,871,508.49

6.期末基金资产净值 236,871,508.49

7.期末基金份额净值 100.00

§ 4 报告期期末按行业分类的股票投资组合

§ 5 报告期期末按行业分类的股票投资组合的股票投资组合

§ 6 公司管理的其他基金情况

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 8 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

周大鹏先生 本基金的基金经理 2011年9月26日 - 4.5年 硕士学位,毕业于中国人民大学,2008年7月就任银华基金管理有限公司,曾任担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理职务,自2012年8月23日起兼任上证50等权重股票型开放式指数证券投资基金基金经理,自2012年9月29日起兼任银华恒生50等权重股票型开放式指数证券投资基金基金经理,自2013年5月22日起兼任银华中证港股通恒生股票型指数基金基金经理,自2013年6月1日起兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理,具有从业资格。国籍:中国。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守行业规范的说明

本基金管理人在报告期内严格遵守《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》及其他法律法规、《银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)基金合同》和基金招募说明书的约定,在服务基金份额持有人的前提下,严格按照基金合同的规定,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无法违法、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 公平交易制度的执行情况

在交易环节,本基金严格执行“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则,在事前监控环节,本基金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和整改。

4.4 投资管理人在报告期内严格履行公平交易制度的相关规定。

4.5 异常交易行为的专项说明

本基金的基金管理人于本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.6 报告期内本基金投资的前十名证券的偏离度

由于四舍五入的原因,比例的分母之和可能不是100%。

4.7 报告期内收到的各类存款的期末余额

4.8 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金的基金管理人于本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.9 投资组合报告

本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.10 备查文件目录

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.11 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.12 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.13 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.14 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.15 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.16 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.17 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.18 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.19 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.20 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.21 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.22 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.23 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.24 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.25 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.26 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.27 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.28 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.29 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.30 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.31 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.32 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.33 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.34 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.35 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.36 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.37 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.38 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.39 备查文件

注:本基金于2014年1月4日转为分级基金,转型后的基金名称为“银华沪深300指数分级证券投资基金(LOF)”,原基金资产净值为100亿元,原份额净值为1.00元,原份额折算后总份额为100亿份,其中A类基金份额为60亿份,B类基金份额为40亿份。

4.40 备查文件

注:本基金于2