银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2018年8月28日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金		
基金简称	银华中证800等权指数增强分级		
场内简称	800分级		
基金主代码	161825		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年11月5日		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	41,701,510.18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	2013年12月11日		
下属分级基金的基金简称	中证800A	中证800B	800分级
下属分级基金的交易代码	150138	150139	161825
报告期末下属分级基金份额总额	1,784,321.00份	1,784,321.00份	38,132,868.18份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证800等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。		
投资策略	本基金以中证800等权重指数为目标指数，在有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。 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800等权重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。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。 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%－95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证800等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%；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。		
业绩比较基准	95%×中证800等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率（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，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。		
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		银华基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333，(010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010)66594942

2.4 信息披露方式

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住所

§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(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	-3,880,951.36
本期利润	-6,253,617.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1373
本期加权平均净值利润率	-14.60%
本期基金份额净值增长率	-14.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	446,416.72
期末可供分配基金份额利润	0.0107
期末基金资产净值	34,663,648.04
期末基金份额净值	0.831
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	26.89%

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中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。

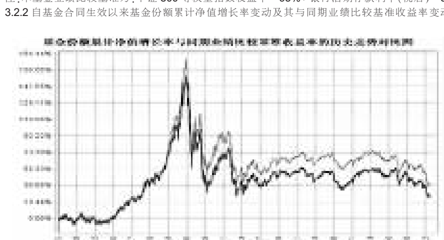
3.2 基金净值表现

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	-6.94%	1.58%	-9.24%	1.60%	2.30%	-0.02%
过去三个月	-12.71%	1.23%	-13.45%	1.20%	0.74%	0.03%
过去六个月	-14.77%	1.31%	-15.82%	1.24%	1.05%	0.07%
过去一年	-10.09%	1.09%	-15.10%	1.04%	5.01%	0.05%
过去三年	-38.38%	1.68%	-37.56%	1.70%	-0.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	26.89%	1.60%	38.88%	1.63%	-11.99%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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



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，建仓期结束时本基金的各项投资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%－95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证800等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%；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2.222亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司44.10%，第一创业证券股份有限公司26.10%，东北证券股份有限公司18.90%，山西海鑫实业股份有限公司0.90%，杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。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。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至2018年6月30日，本基金管理人管理着100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、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(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、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、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、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、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、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证5年期国债指数证券投资基金、银华上证10年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证5年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证10年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证AAA信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金。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：任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	2013年11月5日	-	18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，自2010年5月7日起担任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，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。具有从业资格。国籍：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013年11月5日	-	8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2012年11月14日起担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2016年4月7日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年4月25日起兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7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。

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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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800等权重指数增强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，本基金管理人所有投资组合不存在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。

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、结构配比校验、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

截至本报告期末本基金份额净值为0.831元；本报告期基金份额净值增长率为-14.77%，业绩比较基准收益率为-15.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年A股市场震荡下跌，先是延续去年下半年上涨行情持续一段时间，继而震荡下跌，尤其是6月受中美贸易战和地产棚改降温的负面影响，市场出现大幅度普跌调整。从风格方面，价值蓝筹和新兴成长轮动幅度较大，反映出市场情绪的极不稳定。行业方面，仍然是代表消费升级趋势的食品饮料和餐饮旅游等板块表现强势。

展望2018年下半年，预计宏观经济将平稳运行。国内经济韧性在二季度已逐步得到验证，名义与实际的分化开始弥合，4月开始库存去化加速加快，A股盈利增速温和放缓。从数据上看，本轮复苏中国领先，PMI指标欧洲和日本有所回落，美国与中国向上，OECD领先指标看欧元区有所下降，北美和亚洲向上。从国内经济基本面看，地产推动下周期行业整体并未出现明显下滑，地产销售新开工持续改善，产业链有望持续向上，政策风险将是制约地产行业的最大风险，上游煤炭、钢铁、水泥行业价格向上、库存向下，石化行业价格高位波动，库存低位震荡，景气度有望维持。中游重卡和工程机械行业销量维持高速增长。而加杠杆导致的可支配收入增速的下降可能会对消费造成了一定的压力，但目前看食品饮料等价格仍保持平稳或者向上的态势，家电等也量价平稳，新能源车产销两旺。政策面上，贸易战压力下，补短板、创新药等方向仍会有催化剂。板块方面，周期股已经对还未恶化的数据做出了提前反映，消费股持仓集中度仍然较高也蕴藏着消费数据增速放缓的风险，相对收益方向上整体更看好超跌的金融和周期板块，创新类板块更看好新能源车、计算机和医药，消费品类依旧是食品饮料最适合避险。

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历。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800分级份额、中证800A份额、中证800B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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为2018年2月6日至2018年6月30日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	2,011,025.99	3,101,969.55
结算备付金	407,427.57	110,278.77
存出保证金	9,405.01	3,811.20
交易性金融资产	32,526,011.79	47,988,652.41
其中：股票投资	32,526,011.79	47,988,652.41
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	526.87	679.81
应收股利	-	-
应收申购款	1,098.68	662.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	34,955,495.91	51,206,054.48
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	416.57	9.93
应付管理人报酬	29,711.04	43,064.03
应付托管费	5,942.20	8,612.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,943.42	2,584.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	250,834.64	395,000.04
负债合计	291,847.87	449,271.35
所有者权益：		
实收基金	27,315,255.63	34,094,045.98
未分配利润	7,348,392.41	16,662,737.15
所有者权益合计	34,663,648.04	50,756,783.13
负债和所有者权益总计	34,955,495.91	51,206,054.48

注：报告截止日2018年6月30日，800分级份额净值为人民币0.831元，中证800A份额净值为人民币1.029元，中证800B份额净值为人民币0.633元；基金份额总额为41,701,510.18份，其中800分级份额为38,132,868.18份，中证800A份额为1,784,321.00份，中证800B份额为1,784,321.00份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-5,541,393.02	-1,076,945.46
1.利息收入	12,536.92	15,539.39
其中：存款利息收入	12,536.92	15,539.39
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）	-3,195,803.32	-4,880,575.72
其中：股票投资收益	-3,467,922.92	-5,236,644.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	272,119.60	356,069.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,372,665.82	3,783,576.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	14,539.20	4,514.19
减：二、费用	712,224.16	860,194.21
1. 管理人报酬	212,859.28	235,725.73
2. 托管费	42,571.83	47,145.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	145,656.73	265,423.21
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	311,136.32	311,900.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,253,617.18	-1,937,139.67
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,253,617.18	-1,937,139.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	34,094,045.98	16,662,737.15	50,756,783.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,253,617.18	-6,253,617.18
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）	-6,778,790.35	-3,060,727.56	-9,839,517.91
其中：1.基金申购款	1,609,991.69	834,852.56	2,444,844.25
2.基金赎回款	-8,388,782.04	-3,895,580.12	-12,284,362.16
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）	27,315,255.63	7,348,392.41	34,663,648.04
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	33,305,188.79	15,930,623.29	49,235,812.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,937,139.67	-1,937,139.67
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）	4,471,126.38	1,515,919.66	5,987,046.04
其中：1.基金申购款	7,407,372.61	2,874,035.83	10,281,408.44
2.基金赎回款	-2,936,246.23	-1,358,116.17	-4,294,362.40
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）	37,776,315.17	15,509,403.28	53,285,718.45

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：

王立新　　　　凌宇翔　　　　伍军辉

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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.2.3 差错更正的说明

无。

6.4.3 税项

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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号文《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、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、中国证监会财税[2015]101号文《关于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2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

无。

6.4.4.2 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
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	212,859.28	235,725.73
其中：支付销售机构的客户维护费	26,604.58	35,887.75

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×1.00%/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

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	42,571.83	47,145.14

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×0.20%/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

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.5.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国银行	2,011,025.99	11,275.80	3,702,216.24	12,328.24

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.6.2 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
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	74,600	484,991.92	435,664.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	18.08	-	-	20,100	388,052.13	363,408.00	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项	5.80	-	-	6,300	38,568.00	36,540.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	12.92	-	-	2,347	55,759.18	30,323.24	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	-	-	1,700	33,174.00	25,551.00	-
000693	*ST华泽	2018年5月2日	重大事项	1.00	-	-	4,123	84,995.70	4,123.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项	19.58	2018年8月21日	17.62	100	2,686.38	1,958.00	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大事项	15.27	-	-	41	858.87	626.07	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	32,526,011.79	93.05
	其中：股票	32,526,011.79	93.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,418,453.56	6.92
8	其他各项资产	11,030.56	0.03
9	合计	34,955,495.91	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境内股票投资组合

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	30,980.00	0.09
B	采矿业	1,901,024.40	5.48
C	制造业	15,849,245.22	45.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	515,620.00	1.49
E	建筑业	744,847.07	2.15
F	批发和零售业	2,396,627.05	6.91
G	交通运输、仓储和邮政业	986,254.50	2.85
H	住宿和餐饮业	24,837.12	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,479,573.00	4.27
J	金融业	2,774,830.40	8.01
K	房地产业	1,934,873.20	5.58
L	租赁和商务服务业	459,139.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,084,808.80	3.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,310.00	0.02
Q	卫生和社会工作	122,702.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,839,986.00	5.31
S	综合	-	-
	合计	32,153,657.76	92.76

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	4,123.00	0.01
C	制造业	366,917.39	1.06
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	452.64	0.00
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	732.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	129.00	0.00
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	372,354.03	1.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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前十名股票投资明细

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	300251	光线传媒	160,200	1,630,836.00	4.70
2	600426	华鲁恒升	81,200	1,428,308.00	4.12
3	601717	郑煤机	221,700	1,288,077.00	3.72
4	600885	宏发股份	38,203	1,143,033.76	3.30
5	000826	启迪桑德	62,060	1,084,808.80	3.13
6	600566	济川药业	22,152	1,067,504.88	3.08
7	000776	广发证券	76,900	1,020,463.00	2.94
8	002410	广联达	36,600	1,014,918.00	2.93
9	600038	中直股份	23,100	923,769.00	2.66
10	002251	步步高	78,200	889,916.00	2.57

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票信息，应阅读登载于http://www.yhfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	000666	经纬纺机	20,100	363,408.00	1.05
2	000693	*ST华泽	4,123	4,123.00	0.01
3	300450	先导智能	99	2,993.76	0.01
4	300188	美亚柏科	40	732.00	0.00
5	002129	中环股份	58	454.14	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票信息，应阅读登载于http://www.yhfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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	601717	郑煤机	2,093,192.00	4.12
2	300251	光线传媒	1,924,371.00	3.79
3	600426	华鲁恒升	1,705,477.00	3.36
4	600885	宏发股份	1,690,591.04	3.33
5	000786	北新建材	1,628,237.37	3.21
6	000826	启迪桑德	1,376,497.40	2.71
7	000727	华东科技	1,170,435.00	2.31
8	600038	中直股份	1,119,907.00	2.21
9	000997	新大陆	1,114,989.00	2.20
10	000776	广发证券	1,076,326.00	2.12
11	600737	中粮糖业	1,070,111.00	2.11
12	002251	步步高	1,040,791.00	2.05
13	002410	广联达	1,013,611.00	2.00
14	000975	银泰资源	992,263.00	1.95
15	600651	飞乐音响	981,992.00	1.93
16	000050	深天马A	959,114.00	1.89
17	002242	九阳股份	946,656.00	1.87
18	002195	二三四五	919,019.00	1.81
19	601633	长城汽车	900,089.00	1.77
20	000671	阳光城	897,019.00	1.77

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	601168	西部矿业	1,335,355.00	2.63
2	300274	阳光电源	1,257,079.09	2.48
3	600183	生益科技	1,208,869.00	2.38
4	000997	新大陆	1,206,802.00	2.38
5	600126	杭钢股份	1,172,064.00	2.31
6	002093	国脉科技	1,168,346.00	2.30
7	000039	中集集团	1,159,504.77	2.28
8	603369	今世缘	1,127,041.85	2.22
9	600737	中粮糖业	1,105,012.00	2.18
10	000786	北新建材	1,063,471.00	2.10
11	603883	老百姓	1,062,080.00	2.09
12	600260	凯乐科技	1,031,456.00	2.03
13	600859	王府井	999,321.00	1.97
14	600642	申能股份	980,465.00	1.93
15	002195	二三四五	946,343.00	1.86
16	000021	深科技	932,377.00	1.84
17	000050	深天马A	926,095.97	1.82
18	601678	滨化股份	917,214.60	1.81
19	600651	飞乐音响	912,879.00	1.80
20	002078	太阳纸业	899,888.00	1.77

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	108,770,260.70
卖出股票收入（成交）总额	118,392,312.58

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	9,405.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	526.87
5	应收申购款	1,098.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,030.56

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

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	000666	经纬纺机	363,408.00	1.05	重大事项
2	000693	*ST华泽	4,123.00	0.01	重大事项

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，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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
中证800A	71	25,131.28	1,018,553.00	57.08%	765,768.00	42.92%
中证800B	517	3,451.30	7,790.00	0.44%	1,776,531.00	99.56%
800分级	1,361	28,018.27	22,781,990.19	59.74%	15,350,877.99	40.26%
合计	1,949	21,396.36	23,808,333.19	57.09%	17,893,176.99	42.91%

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

中证800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	太平资管－建设银行－太平资产乾坤10号资管产品	920,053.00	51.56%
2	李怡名	564,841.00	31.66%
3	未来泽时（上海）资产管理中心（有限合伙）－华夏未来添时三号私募证券投资基金	90,000.00	5.04%
4	郑志坤	75,465.00	4.23%
5	胡葛芳	44,337.00	2.48%
6	黄晖	23,894.00	1.34%
7	张志赟	14,357.00	0.80%
8	林香文	10,400.00	0.58%
9	鹏华资产－平安银行－鹏华资产搏股通金29号（华夏未来）主动管理一期资产管理计划	7,600.00	0.43%
10	戚立丽	6,665.00	0.37%

中证800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	赵红军	181,870.00	10.19%
2	李明华	102,017.00	5.72%
3	王玉印	94,940.00	5.32%
4	查刚	60,419.00	3.39%
5	李芳华	57,400.00	3.22%
6	王亚峰	56,801.00	3.18%
7	乔兴航	49,200.00	2.76%
8	刘洋	30,491.00	1.71%
9	季勇	28,723.00	1.61%
10	陆诘敏	26,507.00	1.49%

800分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	常淑梓	114,503.00	11.53%
2	王平	78,301.00	7.88%
3	马秀莲	77,037.00	7.76%
4	王成	69,852.00	7.03%
5	陈相忠	50,447.00	5.08%
6	太平资管－建设银行－太平资产乾坤10号资管产品	46,924.00	4.72%
7	郑燕玲	42,242.00	4.25%
8	张富煊	40,475.00	4.07%
9	戚立丽	31,729.00	3.19%
10	林玉和	18,408.00	1.85%

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	中证800A	0.00	0.00%
	中证800B	0.00	0.00%
	800分级	159,388.52	0.42%
	合计	159,388.52	0.38%

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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证800A	中证800B	800分级
基金合同生效日（2013年11月5日）基金份额总额	-	-	458,328,703.92
本报告期期初基金份额总额	1,861,621.00	1,861,621.00	48,325,298.15
本报告期基金总申购份额	-	-	2,457,742.26
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	12,804,772.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-77,300.00	-77,300.00	154,600.00
本报告期期末基金份额总额	1,784,321.00	1,784,321.00	38,132,868.18

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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2018年6月23日发布关于副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，苏薪茗先生自2018年6月21日起担任本基金管理人副总经理职务。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券股份有限公司	4	227,162,573.28	100.00%	7,108.47	100.00%	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司 北京高华	3	-	-	-	-	新增2个交易单元
新时代证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增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。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司 北京高华	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期基金租用证券公司交易单元未进行除股票以外的其他证券投资。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018/01/01-2018/06/30	22,735,065.19	0.00	0.00	22,735,065.19	54.52%

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括：

1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于2018年3月28日披露了《关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款及调整赎回费的公告》，修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于2018年4月1日起正式实施。

2、本基金管理人于2018年6月11日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》，自2018年6月12日起调整本基金定期定额投资的最低金额为10元。

3、本基金管理人于2018年6月28日披露了《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金暂停场内申购（含定期定额投资）及跨系统转托管（仅限场外转场内）业务的公告》，本基金自2018年6月29日起暂停场内申购（含定期定额投资）及跨系统转托管（仅限场外转场内）业务。

银华基金管理股份有限公司

2018年8月28日