银华深证100指数分级证券投资基金

2013 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
送出日期:2014年3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2014年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§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:银华100)		
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	23,451,118,623.52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年06月07日		
下属分级基金的基金简称	银华稳进	银华锐进	银华100
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	11,379,696,672.00份	11,379,696,672.00份	691,725,279.52份

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,以实现对深证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	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。 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。 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%)。		
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	关悦
	联系电话	(010)58163000	(010)58560666
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	Guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95568
传真		(010)58163027	(010)58560794

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	-577,508,551.99	-1,067,073,311.14	-157,581,745.25
本期利润	-495,799,291.72	193,448,284.22	-2,281,904,887.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0230	0.0161	-0.3996
本期加权平均净值利润率	-2.97%	1.98%	-37.76%
本期基金份额净值增长率	-4.97%	2.00%	-30.05%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	-3,913,813,763.35	-2,293,722,370.56	-1,399,410,008.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1669	-0.1335	-0.1551
期末基金资产净值	17,502,390,355.15	14,051,768,650.04	7,497,821,562.07
期末基金份额净值	0.746	0.818	0.831
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	-18.30%	-14.03%	-15.71%

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。

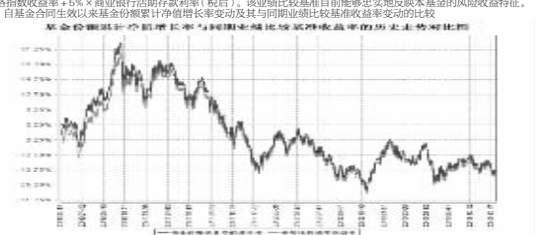
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-3.62%	1.06%	-3.00%	1.10%	-0.62%	-0.04%
过去六个月	5.37%	1.20%	5.92%	1.24%	-0.55%	-0.04%
过去一年	-4.97%	1.32%	-4.53%	1.35%	-0.44%	-0.03%
过去三年	-32.20%	1.34%	-31.44%	1.36%	-0.76%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-18.30%	1.38%	-19.41%	1.43%	1.11%	-0.05%

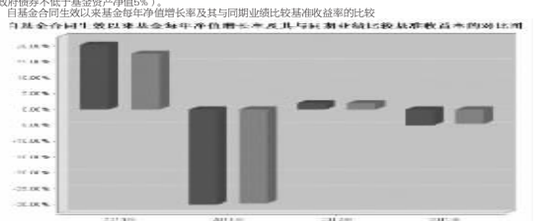
注:本基金的业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。由于本基金的投资标的为深证100价格指数,且本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%,因此,本基金将业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。该业绩比较基准目前能够尽实地反映本基金的风险收益特征。

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



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%)。

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额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:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§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2013年12月31日,本基金管理人管理着35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指数证券投资基金(LOF)、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)、银华永利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)、银华永利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)、银华永利