

# 银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

[illegible]

## 第二季度报告

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	595,159.26	0.27
B	采矿业	12,017,210.57	5.43
C	制造业	75,211,672.51	34.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,568,871.17	3.42
E	建筑业	6,676,259.43	3.02
F	批发和零售业	6,151,994.90	2.78
G	交通运输、仓储和邮政业	5,155,591.49	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	7,938,957.67	3.59
J	金融	70,642,628.96	31.95
K	房地产业	9,564,797.82	4.33
L	租赁和商务服务业	1,824,263.33	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,898,227.33	0.86
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	2,000,243.26	0.90
S	综合	1,651,083.88	0.75
	合计	208,896,961.58	94.47

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	248,436.00	0.11
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	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融	-	-
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	248,436.00	0.11

5.3 报告期末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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	186,254	7,237,232.26	3.31
2	600936	招商局	647,497	6,630,369.28	3.00
3	600016	民生银行	1,065,896	6,619,214.16	3.00
4	601166	兴业银行	457,717	4,590,901.51	2.08
5	601988	工商银行	1,248,763	4,233,306.57	1.91
6	600000	浦发银行	455,528	4,122,528.40	1.86
7	600030	中信证券	318,607	3,651,236.22	1.65
8	000002	万科A	380,507	3,146,729.89	1.42
9	600837	海通证券	332,720	3,044,388.00	1.38
10	000051	格力电器	95,399	2,899,500.55	1.27

5.3.2 报告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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权益投资明细

注:本基金本报告期末未持有权益。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券中包括中国平安(股票代码:601318)。

根据中国平安公开发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年5月21日和2013年10月14日发布的公告,该上市公司控股子公司平安资产管理有限责任公司在投资万科生物(深圳)农业产业股份有限公司发行上市过程中受到中国证券监督管理委员会行政处罚,罚款金额为:110万元。同时该证券存在内幕交易嫌疑。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资行为未发生变更。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其他公允价值投资主体存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,824.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,703.70
5	应收申购款	6,225.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他资产	-
9	合计	33,753.35

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告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的情况。

5.11.6 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项可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

项目	银华300A	银华300B	银华300
报告期期初基金份额总额	3,438,187.00	3,438,187.00	232,387,714.42
报告期期间基金已申购份额	-	-	2,895,880.21
减:报告期期间基金已赎回份额	-	-	14,682,403.84
报告期期间基金净变动份额(份额减少以“-”填列)	-1,303,485.00	-1,303,485.00	260,970.00
报告期末基金份额总额	3,307,702.00	3,307,702.00	220,862,160.79

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对换购份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

无。 § 8 影响投资决策的其他重要信息

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准银华沪深300指数证券投资基金募集文件(010)募集的文件

9.1.2 银华沪深300指数分级证券投资基金招募说明书

9.1.3 银华沪深300指数分级证券投资基金合同

9.1.4 银华沪深300指数分级证券投资基金托管协议

9.1.5 银华基金管理有限公司开放式基金业务规则

9.1.6 基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内基金管理人按规定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文件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。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可合理费用取得上述文件的复印件或复印件。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.jhtund.com.cn)查阅。

银华基金管理有限公司  
2014年7月21日