银华深证100指数分级证券投资基金

【2014】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
送出日期:2014年8月27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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月25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2014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	24,496,071,220.79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6月7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	11,739,083,260.00份	11,739,083,260.00份	1,017,904,700.79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	赵天杰
	联系电话	(010)58163000	(010)58560666
	电子邮箱	yhjf@yhfund.com.cn	zhaotianjie@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办公地址

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-573,281,606.57
本期利润	-994,591,813.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0415
本期加权平均净值利润率	-6.22%
本期基金份额净值增长率	-6.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-5,145,899,584.96
期末可供分配基金份额利润	-0.2101
期末基金资产净值	16,326,113,496.10
期末基金份额净值	0.666
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.01%

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。

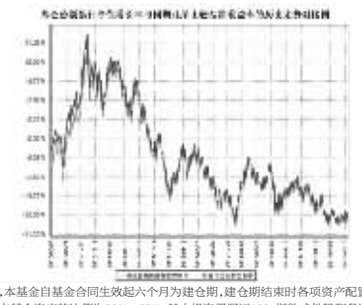
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.52%	0.86%	1.08%	0.88%	0.44%	-0.02%
过去三个月	3.26%	0.85%	2.28%	0.87%	0.98%	-0.02%
过去六个月	-6.98%	1.07%	-7.45%	1.09%	0.47%	-0.02%
过去一年	-1.99%	1.14%	-1.98%	1.17%	-0.01%	-0.03%
过去三年	-33.81%	1.31%	-33.57%	1.33%	-0.24%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-24.01%	1.35%	-25.41%	1.40%	1.40%	-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忠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%)。

§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2014年6月30日,本基金管理人管理着40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、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。	2010年5月7日	-	15.5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,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1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,2013年11月5日起兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:美国。

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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

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、《银华深证100指数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。本基金无违法、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 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,本公司所有投资组合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%的情况有9次,原因是指数型投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

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

截至报告期末,本基金份额净值为0.666元,本报告期份额净值增长率为-6.98%,同期业绩比较基准收益率为-7.45%。报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年上半年A股市场先下跌后窄幅震荡,沪深300指数下跌7.08%,深证100指数下跌7.88%。一季度经济数据极度下滑,二季度以来货币政策向宽松转向,经济增速也开始出现底部企稳,四月份以来,PMI连续两个月明显改善,企业融资状况也出现了企稳迹象,中长期资金增速止跌反弹,同时财政投入也出现了明显加快,随着外围经济的逐步企稳,继一季度美国恶劣天气影响之后,二季度出口有了明显改善,对经济企稳贡献过半。与企稳的经济状况相比,A股市场对经济微刺激效果的预期并不乐观,因调结构政府容忍经济下滑时,投资者担心经济硬着陆,而微刺激转向时,投资者又担心重回增长老路,或者刺激效果有限,A股市场在二季度成交量和指数波动幅度一路走低,成长股大幅波动降低回报率。

展望下半年,房地产市场去泡沫、去库存的过程已经开始,下半年房价和地产投资依然存在进一步回落压力。但出口正在进入可维持的恢复过程,这将带来企业盈利的恢复,最终引导制造业部门投资活动的恢复。未来较长时期政策将依然延续,落实降低实体经济融资成本仍将是未来一段时间货币政策的重要目标。条件允许时继续努力积极收紧和调整信贷结构,并且在信贷和经济恶化时选择性地刺激干预。短期通胀不存在太大上行压力,预计三季度CPI大概率在2.6%左右波动。地产成交下滑仍将持续形成负面冲击,但在外需企稳和稳增长刺激的影响下,经济有望延续阶段性企稳。从资金层面看,二级市场增量资金依然难见,即将开通的沪港通或将对A股高分红蓝筹提供配置价值,这类公司集中于银行、交运、地产、电力等行业。

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,本基金(包括银华100分额、银华稳进份额、银华锐进份额)不进行收益分配。

§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

中国民生银行根据《银华深证100指数分级证券投资基金基金合同》和《银华深证100指数分级证券投资基金托管协议》,托管银华深证100指数分级证券投资基金(以下简称"银华深证100指数分级")。

本报告期,中国民生银行在银华深证100指数分级的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,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基金托管人应尽的义务。

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,按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人——银华基金管理有限公司在银华深证100指数分级投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期,基金管理人——银华基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

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

由银华深证100指数分级的基金管理人——银华基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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:银华深证100指数分级证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	1,241,752,740.79	1,186,991,993.66
结算备付金	17,769,913.77	7,523,850.22
存出保证金	10,563,483.89	8,586,203.86
交易性金融资产	15,153,150,090.31	16,323,895,168.88
其中:股票投资	15,153,150,090.31	16,323,895,168.88
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	271,511.21	365,624.70
应收股利	-	-
应收申购款	25,532.02	91,603.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,423,533,271.99	17,527,454,444.74
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	7,988,840.38	-
应付赎回款	67,606,015.37	414,772.70
应付管理人报酬	13,329,662.57	14,862,921.64
应付托管费	2,665,932.53	2,972,584.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,195,166.84	6,561,000.45
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	634,158.20	252,810.44
负债合计	97,419,775.89	25,064,089.59
所有者权益:		
实收基金	21,472,013,081.06	21,416,204,118.50
未分配利润	-5,145,899,584.96	-3,913,813,763.35
所有者权益合计	16,326,113,496.10	17,502,390,355.15
负债和所有者权益总计	16,423,533,271.99	17,527,454,444.74

注:报告截止日2014年6月30日,银华100份额净值为人民币0.666元,银华稳进份额净值为人民币1.029元,银华锐进份额净值为人民币0.303元;基金份额总额为24,496,071,220.79份,其中银华100份额为1,017,904,700.79份,银华稳进份额为11,739,083,260.00份,银华锐进份额为11,739,083,260.00份。

6.2 利润表

会计主体:银华深证100指数分级证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-878,264,113.48	-1,536,492,649.66
1.利息收入	5,680,535.25	3,872,303.47
其中:存款利息收入	5,680,535.25	3,872,303.47
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)	-469,588,861.90	19,520,061.20
其中:股票投资收益	-647,065,822.88	-102,256,905.47
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	177,476,960.98	121,776,966.67
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-421,310,206.56	-1,562,785,488.19
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,954,419.73	2,900,473.86
减:二、费用	116,327,699.65	102,656,775.38
1.管理人报酬	79,384,334.10	74,967,224.51
2.托管费	15,876,866.87	14,993,444.91
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	20,828,440.69	12,462,713.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	238,057.99	233,392.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-994,591,813.13	-1,639,149,425.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-994,591,813.13	-1,639,149,425.04

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华深证100指数分级证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	21,416,204,118.50	-3,913,813,763.35	17,502,390,355.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-994,591,813.13	-994,591,813.13
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)	55,808,962.56	-237,494,008.48	-181,685,045.92
其中:1.基金申购款	7,242,447,529.61	-1,829,925,964.52	5,412,521,565.09
2.基金赎回款	-7,186,638,567.05	1,592,431,956.04	-5,594,206,611.01
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)	21,472,013,081.06	-5,145,899,584.96	16,326,113,496.10
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	16,345,491,020.60	-2,293,722,370.56	14,051,768,650.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,639,149,425.04	-1,639,149,425.04
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)	6,411,509,635.83	-1,192,613,937.92	5,218,895,697.91
其中:1.基金申购款	9,241,946,672.74	-1,483,047,637.19	7,758,899,035.55
2.基金赎回款	-2,830,437,036.91	290,433,699.27	-2,540,003,337.64
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)	22,757,000,656.43	-5,125,485,733.52	17,631,514,922.91

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_____ _____杨清_____ _____龚飒____

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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	与本基金的关系
西南证券股份有限公司("西南证券")	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司("第一创业")	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司("东北证券")	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司("中国民生银行")	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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	79,384,334.10	74,967,224.51
其中:支付销售机构的客户维护费	719,849.49	926,617.46

注: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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,876,866.87	14,993,444.91

注: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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资银华稳进、银华锐进、银华100基金份额。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

银华稳进				
关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
第一创业	24,119,914.00	0.21%	-	-

份额单位:份

银华锐进				
关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西南证券	-	-	25,240,000.00	0.22%
东北证券	-	-	160,000.00	0.00%

份额单位:份

银华100				
关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西南证券	1.00	0.00%	1.00	0.00%

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.4.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	1,241,752,740.79	5,497,696.39	1,641,213,234.78	3,729,947.50

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.5.2 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
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项	10.21	2014年8月15日	9.33	13,792,309	140,149,261.57	140,819,474.89	-
000562	宏源证券	2013年10月31日	重大资产重组	8.22	2014年7月28日	8.93	13,330,208	119,281,053.23	109,574,309.76	-
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项	14.36	-	-	6,956,937	124,166,079.38	99,901,615.32	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	重大事项	12.44	2014年8月5日	13.68	5,421,987	89,559,888.57	67,449,518.28	-
000878	云南铜业	2014年4月17日	重大事项	7.61	2014年7月17日	7.50	8,217,867	105,632,117.66	62,537,967.87	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	15,153,150,090.31	92.26
	其中:股票	15,153,150,090.31	92.26
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,259,522,654.56	7.67
7	其他各项资产	10,860,527.12	0.07
8	合计	16,423,533,271.99	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	46,502,184.60	0.28
B	采矿业	356,578,047.27	2.18
C	制造业	8,580,818,721.29	52.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	138,030,026.55	0.85
E	建筑业	144,106,088.20	0.88
F	批发和零售业	302,526,726.24	1.85
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	657,942,324.14	4.03
J	金融业	1,593,936,653.51	9.76
K	房地产业	1,185,893,916.60	7.26
L	租赁和商务服务业	161,447,708.78	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	476,288,664.10	2.92
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	365,762,781.05	2.24
S	综合	140,819,474.89	0.86
	合计	14,150,653,317.22	86.67

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	397,461,323.07	2.43
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	信息传输、软件和信息技术服务业	472,993,562.40	2.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	132,041,887.62	0.81
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