基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年8月27日

银华中小盘精选股票型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

§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。

基金托管人中国工商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	银华中小盘精选股票型证券投资基金
基金简称	银华中小盘股票
基金主代码	180031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	758,961,301.01份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国资本市场层次、市场结构和市场功能的不断完善,通过投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,力求在有效控制投资组合风险的前提下,寻求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为主动式投资管理的股票型基金,根据对宏观经济发展阶段、政府政策引导方向、行业周期状况的考察,综合评价各类资产的风险收益水平,对各类资产采取主动、适度配置,在重点投资于具有高成长的中小盘股票的前提下实现大类资产配置,以求基金资产在权益类资产、固定收益类资产及其他金融工具的投资中实现风险-收益的最佳匹配。
业绩比较基准	天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+中债总指数收益率×20%
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,其预期风险与预期收益水平高于债券基金、货币市场基金与混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	赵会军
	联系电话	(010)58163000	(010)66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95588
传真		(010)58163027	(010)66105798

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	-7,354,794.85
本期利润	8,723,654.21
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期加权平均净值利润率	1.46%
本期基金份额净值增长率	11.91%
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	160,206,263.98
期末可供分配基金份额利润	0.2111
期末基金资产净值	1,069,397,282.61
期末基金份额净值	1.409
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	51.64%

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	3.60%	0.80%	1.85%	0.72%	1.75%	0.08%
过去三个月	2.40%	0.81%	1.99%	0.75%	0.41%	0.06%
过去六个月	11.91%	1.15%	-0.40%	0.89%	12.31%	0.26%
过去一年	42.18%	1.24%	10.15%	0.97%	32.03%	0.27%
过去三年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	51.64%	1.10%	1.56%	1.04%	50.08%	0.06%

注:考虑到本基金正常状态之下的资产配置,本基金选择天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+中债总指数收益率×20%作为本基金产品的业绩比较基准。

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内为建仓期,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:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于中小盘股票的资产不低于股票资产的80%;固定收益类资产占基金资产的比例为0%-35%;权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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、银行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		
王华先生	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资管理部总监及A股基金投资总监。	2013年8月6日	-	13.5年	经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。曾在西南证券有限责任公司任职。2000年10月加盟银华基金管理有限公司(筹),先后在研究策划部、基金经理部工作。曾于2004年3月2日至2007年1月30日任银华保本增值证券投资基金基金经理,于2005年6月9日至2006年10月21日期间任银华货币市场证券投资基金基金经理,自2006年11月16日至2013年11月4日期间任银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
于利强先生	本基金的基金经理助理	2013年8月22日	-	5年	学士学位。2003至2009年期间,曾在安永华明会计师事务所从事审计相关工作,并曾在华禾投资担任投资经理职务,从事风险投资财务分析和尽职调查等工作。2009年7月加盟银华基金管理有限公司,曾担任研究员职务。具备从业资格。国籍:中国。
哈默女士	本基金的基金经理助理	2014年6月23日	-	7年	学士学位。2007年7月加盟银华基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员等职位,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、《银华中小盘精选股票型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投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

报告期内,发达经济体持续复苏:尽管美国经济1季度受暴风雪影响,二季度出现强劲复苏;欧元区年初以来温和复苏但内部出现分化,6月份欧央行推出负利率等一揽子宽松措施,由于通缩风险,未来存在推出QE等进一步宽松政策的可能。中国经济在2014年一季度出现较大回落,中央及时出台财政和货币微刺激政策,结合外需改善的背景,二季度经济出现结构性企稳迹象,出口和基建投资出现改善,但失导行业房地产的销售和投资仍在回落中。

基于以上情况,本基金认为,外需改善,中央微刺激政策见效,宏观经济结构性企稳,降低实体经济资金成本的思想将继续指导相关政策出台,将实质性改善企业盈利能力。今年以来本基金较长时间保持了较低的权益类资产配置比例,较好地回避了市场的系统性风险,在判断经济数据出现改善后,大幅提高了权益类资产配置比例,配置结构上较多选择了以消费、汽车为代表的低估值蓝筹和新能源为代表的周期股,虽然本基金获得了正收益,但是相对收益有所下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.409元,本报告期基金份额净值增长率为11.91%,同期业绩比较基准收益率为-0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,美国和欧元区经济复苏趋势仍将持续,外需改善将有助于中国经济稳定增长,但需要警惕的是原油价格快速上涨,对发达经济体经济复苏的负面影响;而中国经济仍存在被房地产投资拖累的风险,预计中央将继续推行局部微刺激政策予以提前对冲,9-10月份房地产销售情况值得关注。

2014年下半年股票市场仍以结构性机会为主。在局部微刺激政策下,相关受益行业将存在一定投资机会,如高铁、环保和新能源等领域;以科技创新、商业模式创新为代表的新经济仍有结构性机会,但需甄别其中的估值泡沫;以消费为主的稳健成长股已经处于估值较低位置,从中期角度看这些股票已经具有较好的风险收益比。

我们将积极调整持仓结构,提高组合收益弹性,积极寻找在中国经济社会转型大背景下的增量行业,和在这些增量行业中具有长期竞争优势的公司,力争为持有人带来更多的超额回报。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

§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

本报告期内,本基金托管人在对银华中小盘精选股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,银华中小盘精选股票型证券投资基金的管理人——银华基金管理有限公司在银华中小盘精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,银华中小盘精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对银华基金管理有限公司编制和披露的银华中小盘精选股票型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:银华中小盘精选股票型证券投资基金

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	26,163,954.02	12,659,760.07
结算备付金	2,277,512.66	744,909.84
存出保证金	469,828.28	91,018.13
交易性金融资产	1,036,947,032.86	124,934,231.03
其中:股票投资	996,835,032.86	118,574,306.03
基金投资	-	-
债券投资	40,112,000.00	6,359,925.00
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	11,043,561.50	-
应收利息	1,086,067.32	7,428.09
应收股利	-	-
应收申购款	1,214,633.63	1,383,597.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,079,202,590.27	139,820,944.47
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	2,917,392.45	134,529.48
应付赎回款	4,046,177.63	1,412,318.61
应付管理人报酬	1,121,131.33	162,425.72
应付托管费	186,855.23	27,070.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,344,945.22	297,340.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,805.80	55,264.23
负债合计	9,805,307.66	2,088,949.16
所有者权益:		
实收基金	758,961,301.01	109,414,015.70
未分配利润	310,435,981.60	28,317,979.61
所有者权益合计	1,069,397,282.61	137,731,995.31
负债和所有者权益总计	1,079,202,590.27	139,820,944.47

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值人民币为1.409元,基金份额总额为758,961,301.01份。

6.2 利润表

会计主体:银华中小盘精选股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	17,272,203.48	2,479,772.18
1.利息收入	1,419,783.39	38,589.49
其中:存款利息收入	465,524.07	38,589.49
债券利息收入	809,757.15	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	144,502.17	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-610,111.75	11,197,810.10
其中:股票投资收益	-12,130,583.03	11,028,273.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,516,370.05	-
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	7,004,101.23	169,536.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	16,078,449.06	-8,816,622.19
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	384,082.78	59,994.78
减:二、费用	8,548,549.27	1,082,316.04
1.管理人报酬	4,377,767.35	423,196.49
2.托管费	729,627.95	70,532.78
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,231,262.11	402,769.08
5.利息支出	21,235.34	-
其中:卖出回购金融资产支出	21,235.34	-
6.其他费用	188,656.52	185,817.69
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	8,723,654.21	1,397,456.14
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	8,723,654.21	1,397,456.14

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华中小盘精选股票型证券投资基金

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)	109,414,015.70	28,317,979.61	137,731,995.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,723,654.21	8,723,654.21
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)	649,547,285.31	273,394,347.78	922,941,633.09
其中:1.基金申购款	871,365,519.86	361,690,596.56	1,233,056,116.42
2.基金赎回款	-221,818,234.55	-88,296,248.78	-310,114,483.33
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)	758,961,301.01	310,435,981.60	1,069,397,282.61
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)	75,843,829.87	5,771,636.89	81,615,466.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,397,456.14	1,397,456.14
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)	-32,116,428.76	-2,777,282.57	-34,893,711.33
其中:1.基金申购款	12,423,735.09	888,250.50	13,311,985.59
2.基金赎回款	-44,540,163.85	-3,665,533.07	-48,205,696.92
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)	-	-4,785,055.09	-4,785,055.09
五、期末所有者权益(基金净值)	43,727,401.11	-393,244.63	43,334,156.48

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

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计估计变更事项。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期间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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化的情况。

6.4.3.2 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
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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	4,377,767.35	423,196.49
其中:支付销售机构的客户维护费	1,102,930.74	138,172.41

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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	729,627.95	70,532.78

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

份额单位:份

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
基金合同生效日(2012年6月20日)持有的基金份额	20,000,400.02	20,000,400.02
期初持有的基金份额	20,000,400.02	20,000,400.02
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,000,400.02	20,000,400.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.64%	45.74%

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

注:除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

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
中国工商银行	26,163,954.02	433,747.50	3,628,973.25	35,850.29

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在承销期内参与关联方承销证券。

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需要说明的其他关联交易事项。

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

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600703	三安光电	2014年1月30日	2015年1月28日	非公开发行流通受限	21.80	22.46	130,596	2,846,992.80	2,933,186.16	-
002353	杰瑞股份	2014年2月14日	2015年2月17日	非公开发行流通受限	69.98	40.25	52,543	2,451,329.42	2,114,855.75	-
603328	依顿电子	2014年6月23日	2014年7月1日	新股流通受限	15.31	15.31	70,600	1,080,886.00	1,080,886.00	-

注:杰瑞股份于2014年6月9日除权除息,向2014年6月6日收市后在册股东每10股派2.5元人民币(含税);同时,以资本公积金向股东每10股转增5股。除权除息后非公开增发部分股票成本价格为46.65元。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	996,835,032.86	92.37
	其中:股票	996,835,032.86	92.37
2	固定收益投资	40,112,000.00	3.72
	其中:债券	40,112,000.00	3.72
	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	28,441,466.68	2.64
7	其他各项资产	13,814,090.73	1.28
8	合计	1,079,202,590.27	100.00

7.2 期末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	采矿业	-	-
C	制造业	853,144,524.92	79.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,612,699.35	0.99
E	建筑业	31,612,089.15	2.96
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	4,326,588.72	0.40
J	金融业	24,779,597.22	2.32
K	房地产业	19,586,544.00	1.83
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	52,772,989.50	4.93
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	996,835,032.86	93.21

7.3 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

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	300274	阳光电源	4,895,860	80,830,648.60	7.56
2	002202	金风科技	8,183,070	77,657,334.30	7.26
3	600703	三安光电	3,143,590	73,527,635.58	6.88
4	000895	双汇发展	1,933,478	69,199,177.62	6.47
5	000625	长安汽车	5,000,074	61,550,910.94	5.76
6	000848	承德露露	2,982,968	59,271,574.16	5.54
7	002353	杰瑞股份	1,350,995	54,377,548.75	5.08
8	600887	伊利股份	1,385,677	45,893,622.24	4.29
9	300263	隆华节能	3,002,004	45,780,561.00	4.28
10	000651	格力电器	1,395,563	41,099,330.35	3.84

注:投资者欲了解本报告期末基金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	000895	双汇发展	74,497,939.84	54.09
2	600703	三安光电	71,811,386.85	52.14
3	002202	金风科技	70,151,996.50	50.93
4	300274	阳光电源	65,328,939.83	47.43
5	002353	杰瑞股份	57,595,309.31	41.82
6	000625	长安汽车	57,255,488.46	41.57
7	000848	承德露露	54,146,219.83	39.31
8	600887	伊利股份	48,253,632.35	35.03
9	000651	格力电器	45,121,898.56	32.76
10	002004	华邦颖泰	43,279,810.61	31.42
11	002065	东华软件	43,017,790.80	31.23
12	002271	东方雨虹	37,024,983.48	26.88
13	002081	金螳螂	36,521,577.29	26.52
14	300263	隆华节能	36,327,579.06	26.38
15	300055	万邦达	35,881,406.53	26.05
16	000768	中航飞机	34,624,141.65	25.14
17	002531	天顺风能	34,265,402.80	24.88
18	002557	洽洽食品	32,823,532.65	23.83
19	300072	三聚环保	31,512,713.04	22.88
20	000333	美的集团	31,501,403.05	22.87
21	600522	中天科技	30,376,142.37	22.05
22	300070	碧水源	29,325,694.43	21.29
23	002063	远光软件	28,023,441.69	20.35
24	601318	中国平安	25,165,781.23	18.27
25	601028	玉龙股份	25,139,224.80	18.25
26	000069	华侨城A	24,871,011.24	18.06
27	600588	用友软件	24,548,023.96	17.82
28	600690	青岛海尔	21,382,290.82	15.52
29	600048	保利地产	20,779,332.00	15.09
30	600456	宝钛股份	20,690,307.33	15.02
31	600776	XD东方通	20,246,286.00	14.70
32	601877	正泰电器	20,072,353.18	14.57
33	600624	复旦复华	20,012,973.88	14.53
34	600343	航天动力	19,627