

(上接B368版)

资产	本期 2014年1月6日	上年度可比期间 2013年12月31日
资产:		
银行存款	13,376,964.36	13,867,926.03
货币资金	140,388.38	241.71
存出保证金	44,803.82	56,794.56
交易性金融资产	227,463,787.46	236,871,508.49
其中:股票投资	227,463,787.46	236,871,508.49
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	4,832.12	3,151.96
应收股利	-	-
应收申购款	10,029,740.74	41,356.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	251,060,436.88	250,840,979.46
负债和所有者权益		
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	906,209.91	142,866.02
应付管理人报酬	20,361.66	108,486.96
应付托管费	6,108.49	32,546.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	125,506.84	125,506.84
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	61,026.28	54,106.78
负债合计	1,119,213.18	460,515.29
所有者权益:		
实收基金	359,021,612.58	346,343,221.57
未分配利润	-109,080,388.88	-95,965,757.40
所有者权益合计	249,941,223.70	250,377,464.17
负债和所有者权益总计	251,060,436.88	250,840,979.46

注:1.报告截止日2014年1月6日,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为249,941,223.01份。

2.本基金合同于2014年1月7日终止,本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年1月6日期间。

7.2 利润表
会计主体:银华沪深300指数证券投资基金(LOP)
本报告期:2014年1月1日至2014年1月6日

资产	本期 2014年1月1日至2014年1月6日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-9,405,931.60	-28,297,051.08
1.利息收入	1,680.16	71,664.95
其中:存款利息收入	1,680.16	71,664.95
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)	-	-61,039,189.82
其中:股票投资收益	-	-64,179,719.32
基金投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-9,407,721.03	32,619,628.77
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	109.27	50,905.02
减:一、费用	33,093.83	3,688,502.54
1.管理人报酬	20,361.66	796,609.76
2.托管费	6,108.49	238,982.90
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-	2,442,981.99
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	6,739.68	209,927.89
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-9,439,141.43	-31,985,553.62
减:所得税费用	-	-
三、净利润(净亏损以“-”号填列)	-9,439,141.43	-31,985,553.62

注:本基金合同于2014年1月7日终止,本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年1月6日期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:银华沪深300指数证券投资基金(LOP)
本报告期:2014年1月1日至2014年1月6日

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月6日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	346,343,221.57	250,377,464.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,439,141.43
三、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	12,678,391.01	9,002,900.96
其中:1.基金申购款	14,202,781.85	10,999,069.23
2.基金赎回款	-1,524,390.84	-1,096,168.27
四、本期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)	359,021,612.58	249,941,223.70
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	423,708,161.97	333,727,648.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-31,985,553.62
三、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-32,744,388.75	-26,268,829.20
其中:1.基金申购款	41,554,415.08	32,748,208.50
2.基金赎回款	-14,298,803.83	-19,017,037.70
四、本期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)	390,963,773.22	275,473,266.14

注:本基金合同于2014年1月7日终止,本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年1月6日期间。

财务报表为财务报表的组成部分。
本报告 7.1 至 7/4 财务报表由下列负责人签署:
基金管理人 基金托管人 基金管理人 基金托管人
基金管理人 基金托管人 基金管理人 基金托管人
基金管理人 基金托管人 基金管理人 基金托管人

7.4 本报告期所采用的会计政策与上一会计期间保持一致的说明
7.4.1 本报告期所采用的会计政策与上一会计期间保持一致的说明
7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

7.4.2 会计政策变更的说明
7.4.3 会计政策变更的说明
7.4.4 会计政策变更的说明
7.4.5 会计政策变更的说明

资产中一次性支付给基金管理人。
7.4.4.2.2 基金托管费

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月6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	6,108.49	238,982.90

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.15%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,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。
7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
注:本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和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。
7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.4.4.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
注:本基金的基金管理人于2014年1月1日至2014年1月6日止期间和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。
7.4.4.4.2 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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末(2014年1月6日)和上年度均未持有本基金股份。
7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1月6日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
中国建设银行	13,376,964.36	1,641.42
中国工商银行	1,641.42	23,575,769.56
中国建设银行	13,376,964.36	1,641.42
中国工商银行	1,641.42	23,575,769.56

7.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
注:本基金于本报告期间及上年度可比期间均未在承销期间内参与关联方承销证券。
7.4.4.7 其他关联交易事项的说明
本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间及上年度可比期间均无其他关联交易事项。
7.4.5 期末(2014年1月6日)本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 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。
7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000562	宏磊股份	2013年10月31日	重大资产重组	8.22	2014年7月26日	8.93	68,538	656,335.38	563,382.36	-
000060	中金黄金	2014年1月21日	重大事项	6.28	2014年1月9日	5.90	66,624	492,674.4	418,398.72	-

7.4.5.3 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。
7.4.5.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.4.5.5 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。
7.4.5.6 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。
7.4.5.7 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,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

8.1 期末基金资产组合情况
8.1.1 期末基金资产组合情况
8.1.2 期末基金资产组合情况
8.1.3 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	209,145,397.58	94.24
其中:股票	209,145,397.58	94.24	
2	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	12,754,382.17	5.75
7	其他各项资产	33,753.35	0.02
8	合计	221,933,533.10	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1 期末按行业分类的股票投资组合
8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合
8.2.3 期末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	595,159.26	0.27
B	采矿业	12,017,210.57	5.43
C	制造业	73,211,672.31	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	5,155,931.49	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	金融业	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

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
8.2.3 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
8.2.4 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
8.2.5 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	-	-
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	金融业	-	-
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

8.3.1 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十名股票投资组合
8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

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	601318	中国平安	186,254	7,327,232.36	3.31
2	600036	招商银行	647,407	6,630,369.28	3.00
3	600016	民生银行	1,065,896	6,679,214.16	2.99
4	601166	兴业银行	457,717	4,599,901.51	2.08
5	601398	工商银行	1,248,763	4,233,306.57	1.91
6	600000	浦发银行	445,528	4,122,528.40	1.86
7	600030	中信证券	318,007	3,651,236.22	1.65
8	000002	万科A	380,507	3,146,792.89	1.42
9	600837	海通证券	332,720	3,044,388.00	1.38
10	000651	格力电器	95,399	2,809,500.55	1.27

注:投资者欲了解本报告期内基金指数投资的所有股票信息,应阅读载于http://www.yinfund.com.cn网站的半年度报告正文。
8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.3.2 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十名股票投资组合
8.3.3 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十名股票投资组合
8.3.4 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十名股票投资组合

8.4.3 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	71,420,229.75
卖出股票收入(成交)总额	82,204,044.20

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。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
8.6 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
8.7 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
8.8 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
8.9 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证投资明细
8.10 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。
8.11 报告期末本基金