（上接B254版）

项目	本期末 2014年1月6日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	13,376,964.36	13,867,926.03
结算备付金	140,308.38	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	本期末 2014年1月6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	–	–
应付赎回款	906,209.91	142,866.02
应付管理人报酬	20,361.66	108,488.96
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	–	–
应付利润	–	–
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	463,515.29
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，基金份额净值人民币1.000元，基金份额总额249，941，223.01份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间系2014年1月1日至2014年1月6日止。自2014年1月7日起，《银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效且《银华沪深300指数分级证券投资基金基金合同》生效，同时“银华沪深300指数证券投资基金(LOF)”更名为“银华沪深300指数分级证券投资基金”。

8.2 利润表

会计主体：银华沪深300指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2014年1月1日至2014年1月6日

单位：人民币元

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12月31日
一、收入	−9,405,931.60	−17,712,495.53
1.利息收入	1,680.16	177,530.90
其中：存款利息收入	1,680.16	177,530.90
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)	–	−55,608,557.80
其中：股票投资收益	–	−60,669,673.43
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	–	5,061,115.63
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	−9,407,721.03	37,235,708.47
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)	109.27	482,822.90
减：二、费用	33,209.83	6,304,169.05
1.管理人报酬	20,361.66	1,523,273.08
2.托管费	6,108.49	456,981.97
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	–	3,890,352.37
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	433,561.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	−9,439,141.43	−24,016,664.58
减：所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	−9,439,141.43	−24,016,664.58

8.3 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(LOF)

本报告期：2014年1月1日至2014年1月6日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月6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)	346,343,221.57	−95,965,757.40	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	−9,439,141.43
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）	12,678,391.01	−3,675,490.05	9,002,900.96
其中：1.基金申购款	14,202,781.85	−4,103,712.62	10,099,069.23
2.基金赎回款	−1,524,390.84	428,222.57	−1,096,168.27
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)	359,021,612.58	−109,080,388.88	249,941,223.70
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	423,708,161.97	−89,980,513.01	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)	–	−24,016,664.58	−24,016,664.58
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）	−77,364,940.40	18,031,420.19	−59,333,520.21
其中：1.基金申购款	500,053,117.52	−121,109,266.35	378,943,851.17
2.基金赎回款	−577,418,057.92	139,140,686.54	−438,277,371.38
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)	346,343,221.57	−95,965,757.40	250,377,464.17

报表附注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：

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

8.4 报表附注

8.4.1 基金基本情况

银华沪深300指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]793号文《关于核准银华沪深300指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由银华基金管理有限公司依照《基金法》、基金合同及其他有关规定于2009年9月4日至2009年9月30日向社会公开募集，基金合同于2009年10月14日生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为670，189，105.75份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议备案的回函）（证监许可字[2013]1061号），银华沪深300指数证券投资基金(LOF)终止上市，采用分级运作，并修订基金合同。自2014年1月7日起，《银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效且《银华沪深300指数分级证券投资基金基金合同》生效，同时“银华沪深300指数证券投资基金(LOF)”更名为“银华沪深300指数分级证券投资基金”。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，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的5%。在保证流动性的前提下，如果法律法规允许，在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准选定为：95%×沪深300指数收益率+5×商业银行活期存款利率（税后）

8.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年1月6日的财务状况以及2014年1月1日至2014年1月6日止期间的经营成果和净值变动情况。

经在中国证监会备案，基金管理人银华基金管理有限公司将银华沪深300指数证券投资基金(LOF)于2014年1月7日转型为银华沪深300指数分级证券投资基金，存续期限不定，因此，本财务报表仍以持续经营为基础列报。

8.4.4 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。

8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

8.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

8.4.5.3 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。

8.4.6 税项

8.4.6.1印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

87.4.6.2营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

8.4.6.3个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

8.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
关联方名称	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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华财富资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司

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。

8.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

8.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

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12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券	–	–	1,026,265.03	0.04%
西南证券	–	–	220,806,614.06	8.76%
第一创业	–	–	23,756,583.96	0.94%

8.4.8.1.2 债券交易

注：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未通过关联方交易单元进行债券交易。

8.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于2014年1月1日至2014年1月6日止期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

8.4.8.1.4 权证交易

注：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未通过关联方交易单元进行权证交易。

8.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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12月31日		
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额
西南证券	–	–	15,017.20	908.08	0.04%	–
第一创业	–	–	21,619.26	201,016.26	8.77%	15,017.20
东北证券				21,619.26	0.94%	21,619.26

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,361.66	1,523,273.08
其中：支付销售机构的客户维护费	5,919.87	430,309.73

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.50%/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

8.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年1月6日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,108.49	456,981.97

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

8.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

8.4.8.4.2 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及上年度末均未持有本基金份额。

8.4.8.5 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1月6日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,376,964.36	1,641.42	13,867,926.03	147,802.35

8.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于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。

8.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未为有其他关联交易事项。

8.9.1 期末（2014年1月6日）本基金持有的流通受限证券

8.9.1.1 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持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

8.9.1.2 期末持有的暂时停牌股票

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
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	68,538	656,335.58	563,382.36	–
000060	中金岭南	2014年1月2日	重大事项	6.28	2014年1月9日	5.90	66,624	492,674.47	418,398.72	–

8.1.2.3 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。

8.1.3 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

8.4.14.1承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

8.4.14.2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。

8.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§9 投资组合报告（转型后）

9.1 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	429,621,114.59	91.50
	其中：股票	429,621,114.59	91.50
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	34,773,379.07	7.41
7	其他各项资产	5,113,378.58	1.09
8	合计	469,507,872.24	100.00

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 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	1,253,260.90	0.28
B	采矿业	21,809,937.82	4.81
C	制造业	123,662,919.57	27.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,248,216.53	3.36
E	建筑业	19,490,474.80	4.30
F	批发和零售业	9,343,089.84	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	10,825,616.44	2.39
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,528,027.89	3.20
J	金融业	180,201,658.48	39.72
K	房地产业	19,215,749.58	4.24
L	租赁和商务服务业	3,801,638.59	0.84
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	3,967,838.08	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	106,287.90	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,940,945.87	0.87
S	综合	1,342,915.01	0.30
	合计	428,738,577.30	94.51

9.2.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	456,171.11	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	164,522.69	0.04
F	批发和零售业	128,700.00	0.03
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	71,893.57	0.02
J	金融业	–	–
K	房地产业	61,249.92	0.01
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	882,537.29	0.19

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细(转型后)

9.3.1 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

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	601318	中国平安	265,060	19,802,632.60	4.37
2	600016	民生银行	1,499,511	16,314,679.68	3.60
3	600036	招商银行	942,828	15,641,516.52	3.45
4	600030	中信证券	458,698	15,549,862.20	3.43
5	600837	海通证券	447,828	10,774,741.68	2.38
6	601166	兴业银行	631,761	10,424,056.50	2.30
7	600000	浦发银行	619,167	9,714,730.23	2.14
8	601398	工商银行	1,620,524	7,891,951.88	1.74
9	000002	万 科A	489,928	6,809,999.20	1.50
10	601328	交通银行	867,800	5,901,040.00	1.30

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（http://www.yhfund.com.cn）的年度报告正文。

9.3.2 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五名股票投资明细

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	600584	长电科技	14,000	147,000.00	0.03
2	002171	精诚铜业	10,157	132,751.99	0.03
3	000996	中国中期	4,500	128,700.00	0.03
4	002482	广田股份	5,307	104,388.69	0.02
5	000609	绵世股份	4,416	61,249.92	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（http://www.yhfund.com.cn）的年度报告正文。

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	23,978,432.05	5.29
2	600016	民生银行	18,290,449.68	4.03
3	600036	招商银行	17,828,493.98	3.93
4	600030	中信证券	14,575,979.51	3.21
5	601166	兴业银行	13,052,917.00	2.88
6	600837	海通证券	11,826,110.54	2.61
7	601398	工商银行	11,513,567.00	2.54
8	600000	浦发银行	11,215,016.45	2.47
9	000002	万 科A	9,720,874.18	2.14
10	000651	格力电器	7,851,129.45	1.73
11	601328	交通银行	6,807,700.95	1.50
12	600519	贵州茅台	6,730,746.78	1.48
13	601818	光大银行	6,558,505.70	1.45
14	000001	平安银行	6,454,353.57	1.42
15	601288	农业银行	6,111,630.00	1.35
16	601601	中国太保	6,086,830.93	1.34
17	000783	长江证券	6,005,603.11	1.32
18	601668	中国建筑	5,850,158.28	1.29
19	600104	上汽集团	5,697,439.47	1.26
20	600887	伊利股份	5,562,874.00	1.23

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

9.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	20,827,380.49	4.59
2	600016	民生银行	15,978,560.20	3.52
3	600036	招商银行	14,836,387.95	3.27
4	601166	兴业银行	11,518,446.82	2.54
5	600030	中信证券	11,270,280.02	2.48
6	601398	工商银行	9,839,155.18	2.17
7	600000	浦发银行	9,583,977.12	2.11
8	600837	海通证券	9,506,355.36	2.10
9	000002	万 科A	8,431,304.96	1.86
10	000651	格力电器	7,147,768.72	1.58
11	600519	贵州茅台	6,107,718.49	1.35
12	601328	交通银行	5,745,263.99	1.27
13	601668	中国建筑	5,598,308.90	1.23
14	000783	长江证券	5,325,903.20	1.17
15	601601	中国太保	5,277,010.00	1.16
16	601288	农业银行	5,244,414.14	1.16
17	000001	平安银行	5,107,168.28	1.13
18	601818	光大银行	5,016,255.47	1.11
19	600104	上汽集团	4,923,630.53	1.09
20	000511	烯碳新材	4,855,371.60	1.07

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

9.4.3 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	700,566,086.98
卖出股票收入(成交)总额	628,829,649.24

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。

9.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

9.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

9.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

9.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 投资组合报告附注

9.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

9.12.2 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。

9.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,833.60
2	应收证券清算款	3,911,344.10
3	应收股利	–
4	应收利息	10,902.94
5	应收申购款	1,157,297.94
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,113,378.58

9.12.4 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。

9.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

9.12.5.1 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。

9.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	147,000.00	0.03	重大资产重组
2	002171	精诚铜业	132,751.99	0.03	重大资产重组
3	000996	中国中期	128,700.00	0.03	重大事项
4	002482	广田股份	104,388.69	0.02	重大事项
5	000609	绵世股份	61,249.92	0.01	重大资产重组

8.12.6 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§10 投资组合报告（转型前）

10.1 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	227,463,787.46	90.60
	其中：股票	227,463,787.46	90.60
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	13,517,272.74	5.38
7	其他资产	10,079,376.68	4.01
8	合计	251,060,436.88	100.00

10.2 期末按行业分类的股票投资组合

10.2.1 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	1,592,554.04	0.64
B	采矿业	13,879,468.30	5.55
C	制造业	83,233,110.38	33.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,070,912.04	2.83
E	建筑业	7,718,992.49	3.09
F	批发和零售业	7,029,829.62	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	6,232,120.96	2.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,698,660.34	2.68
J	金融业	76,840,346.39	30.74
K	房地产业	10,138,767.95	4.06
L	租赁和商务服务业	1,569,558.66	0.63
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,059,903.90	0.82
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	1,182,656.56	0.47
S	综合	2,216,905.83	0.89
	合计	227,463,787.46	91.01

10.1.1 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

10.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

10.2.1 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

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	601318	中国平安	221,534	8,925,604.86	3.57
2	600036	招商银行	764,418	7,995,812.28	3.20
3	600016	民生银行	1,038,243	7,672,615.77	3.07
4	601166	兴业银行	526,187	5,082,966.42	2.03
5	600000	浦发银行	515,800	4,740,202.00	1.90
6	601398	工商银行	1,261,073	4,476,809.15	1.79
7	600837	海通证券	372,690	4,058,594.10	1.62
8	600030	中信证券	317,806	3,886,767.38	1.56
9	000651	格力电器	110,983	3,331,709.66	1.33
10	000002	万 科A	444,389	3,324,029.72	1.33

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（http://www.yhfund.com.cn）的年度报告正文。

10.2.2 期末