

**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**  
**报告送出日期:2013年7月17日**

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,投资需谨慎。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。

本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。

本报告期内2013年4月1日起至6月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	银华沪深300指数分级(场内简称:银华300)
交易代码	1801018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月27日
报告期末基金份额总额	9701,120,882.07份

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)
1.本期已实现收益	94,627,979.43
2.本期利润	7,511,136.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0068
4.期末基金资产净值	1,044,170,580.97
5.期末基金份额净值	1.076

**§4 基金业绩比较基准**

沪深300指数收益率×85%+中国债券综合指数收益率×15%

**§5 投资组合报告**

本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产比例70%-95%,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%。

**§6 开放式基金份额变动**

期初基金份额总额	1,301,419,762.46
本期基金份额申购总额	29,580,803.47
减:本期基金份额赎回总额	366,888,515.65
本期基金份额变动额	262,472,050.29
期末基金份额总额	970,120,882.07

**§7 开放式基金份额变动**

1. 存出凭证	607,328.76
2. 应收证券清算款	-
3. 应收股利	-
4. 应收利息	-
5. 应付证券清算款	-
6. 其他应付款	-
7. 应付利息	-
8. 其他	-
9. 合计	5,244,800.68

**§8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	600,000	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	500,000	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	410,000	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	100,000	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	20,000	2,197,725.00	0.21

**§9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312	11月12日	600,000	59,970,000.00	5.74
2	113801	11月12日	500,000	50,058,000.00	4.79
3	128200	09月12日	410,000	42,025,000.00	4.03
4	120245	12月17日	100,000	9,947,000.00	0.95
5	110223	11月12日	20,000	2,197,725.00	0.21

**§10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细**

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110301	11月12日	1,000,000	100,000.00	0.01
2	113801	11月12日	500,000	50,000.00	0.00
3	128200	09月12日	410,000	41,000.00	0.00
4	120245	12月17日	100,000	10,000.00	0.00
5	110223	11月12日	20,000	2,000.00	0.00

**§11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000 海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271 耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271 耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146 深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090 深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222 科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668 尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570 恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066 宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073 联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细**

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.00	4.03
4	120245 1202开尔	9,947,000.00	0.95
5	110223 4008华信	2,197,725.00	0.21

**§25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名衍生品投资明细**

代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	600000	海信电器	7,999,903	83,118,992.17	7.96
2	002271	耀客传媒	5,000,000	78,900,000.00	7.56
3	002271	耀客传媒	2,808,121	31,955,993.00	3.08
4	300146	深赛格	800,000	35,192,000.00	3.37
5	300090	深惠勒	1,600,000	30,880,000.00	2.96
6	002222	科达股份	499,812	26,644,977.22	2.55
7	600668	尖峰集团	2,989,807	25,473,156.64	2.44
8	600570	恒生电子	1,700,000	21,250,000.00	2.04
9	600066	宁波银行	1,297,104	20,481,272.16	1.96
10	002073	联众股份	2,465,351	20,180,894.89	1.93

**§26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110312 川仪股份	59,970,000.00	5.74
2	113801 中信特钢	50,058,000.00	4.79
3	128200 999牧业	42,025,000.	