银华中国梦30股票型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年8月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月24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2015年4月29日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中国梦30股票型证券投资基金
基金简称	银华中国梦30股票
基金主代码	001163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月29日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,660,777,422.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极寻找由中国经济发展模式调整和经济增长方式转型而带来的投资机会,投资于引领和符合这个转型过程、有望在实现"中国梦"过程中成长为中国经济未来蓝筹的优质公司,在严格控制投资组合风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在运用资产配置策略确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险的基础上,精选经济转型中符合"新战略、新模式、新发展"方向,具有良好的公司治理水平,具备可持续增长潜力和合理估值水平的上市公司,通过集中投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险和预期收益水平高于混合型证券投资基金、债券型证券投资基金及货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	田青
	联系电话	(010)58163000	010-67595096
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	010-67595096
传真		(010)58163027	010-66275853

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(2015年4月29日 – 2015年6月30日)
本期已实现收益	197,691,628.95
本期利润	52,826,727.42
加权平均基金份额本期利润	0.0199
本期加权平均净值利润率	1.79%
本期基金份额净值增长率	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	52,826,727.42
期末可供分配基金份额利润	0.0199
期末基金资产净值	2,713,604,149.65
期末基金份额净值	1.020
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.00%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中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。

4、本基金于2015年4月29日成立,截止到本报告期末未满半年,主要财务指标的实际计算期间为2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日。

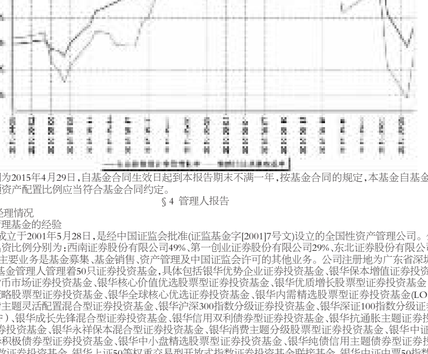
3.2 基金净值表现

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	-9.17%	2.62%	-7.54%	3.16%	-1.63%	-0.54%
自基金合同生效起至今	2.00%	2.07%	-1.49%	2.67%	3.49%	-0.60%

注:中证800指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%,中证800指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证800指数的成份股由中证500指数和沪深300指数成份股一起构成。中债总财富指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。中债总财富指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。

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:本基金合同生效日期为2015年4月29日,自基金合同生效日起到本报告期末不满一年,按基金合同的规定,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应当符合基金合同约定。

§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2015年6月30日,本基金管理人管理着50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、银华信用季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、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦30股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金。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		
薄官辉先生	本基金的基金经理	2015年4月29日	–	11年	硕士学位。2004年7月至2006年5月任职于长江证券股份有限公司研究所,任研究员,从事农业、食品饮料行业研究。2006年6月至2009年5月,任职于中信证券股份有限公司研究部,任高级研究员,从事农业、食品饮料行业研究。2009年6月至今,任职于银华基金管理有限公司研究部,历任消费组食品饮料行业研究员、大宗商品组研究主管、研究部总监助理、研究部副总监,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之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、《银华中国梦30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,在控制风险的前提下,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1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,中国经济增长没有见到显著回升迹象,央行也保持了宽松的货币政策,在上半年实施了3次降息和降低存款准备金率,并通过其他的方式保持市场的流动性。在宽松货币政策刺激下,居民储蓄持续向股市搬家。在政府"大众创业、万众创新"的号召下,移动互联网快速发展和上市公司的转型的预期的推动下,在证券市场上形成了"互联网+"的投资热点。在本报告期,本基金处于建仓期,我们保持了较低的仓位和灵活的操作,对我们看好行业和公司进行了小部分的建仓,主要的配置方向是车联网、军工、农业和TMT行业的公司等。取得了良好的效果,获得了一定的超额收益。

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1.020元,本报告期份额净值增长率为2.00%,同期业绩比较基准收益率为-1.49%。

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2015年下半年,我们认为:美国经济将继续保持复苏态势;欧元区经济也开始逐步好转。中国经济在积极的财政政策、稳健货币政策的刺激下,房地产市场开始呈现复苏的苗头,在多次降准降息,市场深度调整后,越来越多的上市公司体现出较强的投资价值,展望2015年下半年的市场,存在较多的投资机会。在下半年的投资中,我们将遵循以下策略:1)逐步提高仓位。2)在投资方向上,均衡配置,精选个股,重点投向在实现中国梦过程中真正成为支柱企业的上市公司。

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

本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,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,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:银华中国梦30股票型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	1,593,516,236.52
结算备付金		49,306,562.68
存出保证金		472,366.94
交易性金融资产	6.4.7.2	1,207,891,505.10
其中:股票投资		1,207,891,505.10
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	6.4.7.3	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,000,000,000.00
应收证券清算款		–
应收利息	6.4.7.5	301,924.13
应收股利		–
应收申购款		–
递延所得税资产		–
其他资产	6.4.7.6	–
资产总计		3,851,488,595.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负债:		
短期借款		–
交易性金融负债		–
衍生金融负债	6.4.7.3	–
卖出回购金融资产款		–
应付证券清算款		1,127,544,269.80
应付赎回款		–
应付管理人报酬		3,801,841.90
应付托管费		633,640.33
应付销售服务费		–
应付交易费用	6.4.7.7	5,876,637.27
应交税费		–
应付利息		–
应付利润		–
递延所得税负债		–
其他负债	6.4.7.8	28,056.42
负债合计		1,137,884,445.72
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	2,660,777,422.23
未分配利润	6.4.7.10	52,826,727.42
所有者权益合计		2,713,604,149.65
负债和所有者权益总计		3,851,488,595.37

注:1.报告截止日2015年6月30日,基金份额净值为人民币1.020元,基金份额总额为2,660,777,422.23份。

2.本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止。

6.2 利润表

会计主体:银华中国梦30股票型证券投资基金

本报告期:2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日
一、收入		70,849,945.44
1.利息收入		3,311,881.61
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,307,173.10
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		2,004,708.51
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"-"填列)		212,402,781.30
其中:股票投资收益	6.4.7.12	210,268,087.73
基金投资收益		–
债券投资收益	6.4.7.13	–
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	–
贵金属投资收益	6.4.7.14	–
衍生工具收益	6.4.7.15	–
股利收益	6.4.7.16	2,134,693.57
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-144,864,901.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	184.06
减:二、费用		18,023,218.02
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	7,493,646.46
2.托管费	6.4.10.2.2	1,248,941.07
3.销售服务费	6.4.10.2.3	–
4.交易费用	6.4.7.19	9,247,651.58
5.利息支出		–
其中:卖出回购金融资产支出		–
6.其他费用	6.4.7.20	32,978.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		52,826,727.42
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		52,826,727.42

注:本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华中国梦30股票型证券投资基金

本报告期:2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015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)	2,660,777,422.23	–	2,660,777,422.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	52,826,727.42	52,826,727.42
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	2,660,777,422.23	52,826,727.42	2,713,604,149.65

注:本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.1.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止。

6.4.1.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B.首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

(3)因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"

6.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.1.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.1.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配,具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告,若《基金合同》生效不满3个月则不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若基金份额持有人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;红利再投资方式免收再投资的费用;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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 税项

(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、国家税务总局财税字[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。

(2)营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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[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。

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

(3)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2012〕85号《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,证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得实施差别化个人所得税政策。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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 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

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于2015年4月29日生效,无上年度可比期间。

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金于2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止会计期间未通过关联方席位进行交易。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,493,646.46
其中:支付销售机构的客户维护费	4,776,239.16

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为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,248,941.07

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0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.5.3 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2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日止会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人于2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.5.4.2 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:除管理人之外的其他关联方于2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日未持有本基金份额。

6.4.5.5 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 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,593,516,236.52	1,228,462.83

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

注:本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.6 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 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/增发而于期末持有流通受限证券。

6.4.6.2 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
601311	骆驼股份	2015年6月17日	重大事项停牌	23.31	2015年7月15日	25.38	2,060,081	60,056,966.21	48,020,488.11	–
300255	常山药业	2015年6月2日	重大事项停牌	27.58	2015年7月13日	31.24	1,563,650	44,383,780.50	43,125,467.00	–
600366	宁波韵升	2015年5月21日	重大事项停牌	30.71	2015年8月12日	31.58	1,365,620	40,216,230.81	41,938,190.20	–
002001	新和成	2015年6月29日	重大事项停牌	17.09	2015年7月13日	18.49	1,795,389	48,807,180.88	30,683,198.01	–
000887	中鼎股份	2015年6月29日	重大事项停牌	24.75	–	–	912,091	28,419,452.20	22,574,252.25	–
300266	兴源环境	2015年6月2日	重大事项停牌	38.70	–	–	577,225	26,766,722.21	22,338,607.50	–

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.7 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	1,207,891,505.10	31.36
	其中:股票	1,207,891,505.10	31.36
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	1,000,000,000.00	25.96
	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	1,642,822,799.20	42.65
7	其他各项资产	774,291.07	0.02
8	合计	3,851,488,595.37	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	173,456,402.00	6.39
B	采矿业	–	–
C	制造业	603,797,832.20	22.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,432,530.00	2.04
E	建筑业	25,885,253.52	0.95
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	101,756,718.72	3.75
J	金融业	75,592,059.44	2.79
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	26,632,044.42	0.98
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	145,338,664.80	5.36
S	综合	–	–
	合计	1,207,891,505.10	44.51

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	002477	雏鹰农牧	6,105,835	117,232,032.00	4.32
2	600757	长江传媒	5,619,882	78,116,359.80	2.88
3	600770	综艺股份	3,962,563	77,428,481.02	2.85
4	002363	隆基机械	2,057,377	69,559,916.37	2.56
5	300088	长信科技	2,520,248	69,306,820.00	2.55
6	300133	华策影视	2,489,715	67,222,305.00	2.48
7	000998	隆平高科	2,074,700	56,224,370.00	2.07
8	600011	华能国际	3,951,000	55,432,530.00	2.04
9	000858	五粮液	1,726,225	54,721,332.50	2.02
10	601318	中国平安	665,900	54,563,846.00	2.01

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	002477	雏鹰农牧	158,114,932.66	5.83
2	600298	安琪酵母	137,987,622.97	5.09
3	600770	综艺股份	131,604,061.91	4.85
4	601111	中国国航	102,451,023.65	3.78
5	002421	达实智能	94,809,359.22	3.49
6	600757	长江传媒	93,826,047.06	3.46
7	600343	航天动力	93,733,726.10	3.45
8	002111	威海广泰	93,043,973.00	3.43
9	300013	新宁物流	90,289,785.28	3.33
10	002470	金正大	86,920,557.00	3.20
11	300133	华策影视	86,514,522.71	3.19
12	002456	欧菲光	86,037,548.44	3.17
13	002363	隆基机械	85,119,927.83	3.14
14	000821	京山轻机	84,310,390.52	3.11
15	300248	新开普	84,116,641.92	3.10
16	600660	福耀玻璃	76,091,503.88	2.80
17	300088	长信科技	74,479,017.83	2.74
18	300136	信维通信	69,340,401.01	2.56
19	300224	正海磁材	66,244,205.97	2.44
20	000738	中航动控	65,027,436.22	2.40
21	600654	中安消	63,187,212.92	2.33
22	000718	苏宁环球	62,397,780.80	2.30
23	601311	骆驼股份	60,056,966.21	2.21
24	000997	新大陆	59,908,422.26	2.21
25	600703	三安光电	59,308,899.20	2.19
26	600135	乐凯胶片	59,142,439.76	2.18
27	002156	通富微电	58,323,611.46	2.15
28	000998	隆平高科	57,948,405.68	2.14

7.4.2 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	000821	京山轻机	118,690,800.93	4.37
2	600343	航天动力	117,925,618.32	4.35
3	002111	威海广泰	117,531,017.82	4.33
4	601111	中国国航	116,351,706.02	4.29
5	600298	安琪酵母	110,060,434.64	4.06
6	002470	金正大	106,730,324.90	3.93
7	600654	中安消	94,697,399.31	3.49
8	300013	新宁物流	91,849,266.12	3.38
9	002456	欧菲光	80,080,233.34	2.95
10	002156	通富微电	74,029,260.32	2.73
11	600660	福耀玻璃	72,535,459.09	2.67
12	300224	正海磁材	69,467,954.12	2.56
13	000738	中航动控	67,699,494.54	2.49
14	300248	新开普	60,708,588.56	2.24
15	600703	三安光电	60,700,388.74	2.24
16	000997	新大陆	59,692,791.17	2.20
17	300018	中元华电	55,532,505.60	2.05
18	002446	盛路通信	53,919,604.83	1.99
19	600074	保千里	52,766,104.88	1.94
20	600151	航天机电	51,525,631.40	1.90

7.4.3 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	3,798,750,163.54
卖出股票收入(成交)总额	2,656,261,844.64

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	472,366.94
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	301,924.13
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	774,291.07

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
37,870	70,260.82	992,201.00	0.04%	2,659,785,221.23	99.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	8,918.09	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年4月29日)基金份额总额	2,660,777,422.23
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	2,660,777,422.23

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于2015年6月10日发布公告,凌宇翔先生自2015年6月8日起担任本基金管理人副总经理,代为履行督察长职务。

本基金管理人于2015年7月25日发布公告,自2015年7月24日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长,凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	2,292,305,168.90	35.51%	2,086,914.02	35.51%	–
申万宏源证券有限公司	2	1,665,947,423.57	25.81%	1,516,676.34	25.81%	–
国金证券股份有限公司	2	1,585,663,794.52	24.56%	1,443,586.66	24.56%	–
上海华信证券有限责任公司	1	324,469,932.46	5.03%	295,397.03	5.03%	–
民生证券有限责任公司	2	286,826,764.94	4.44%	261,124.84	4.44%	–
东方证券股份有限公司	2	266,693,169.43	4.13%	242,798.91	4.13%	–
华创证券有限责任公司	2	33,105,754.36	0.51%	30,139.47	0.51%	–
首创证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
上海证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
新时代证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
北京高华证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国都证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
东北证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
东莞证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
广州证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
第一创业证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
红塔证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
德邦证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中信万通证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
江海证券有限公司	2	–	–	–	–	–
西部证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东吴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
长城证券有限责任公司	3	–	–	–	–	–
湘财证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
华福证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
华安证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
西南证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
华宝证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	3	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	1	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	2	–	–	–	–	–
瑞银证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中原证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
华融证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国民族证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
渤海证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
日信证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
太平洋证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–

注:1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后,确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

3、本基金合同生效日为2015年4月29日,以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	–	–	7,741,900,000.00	88.56%	–	–
国金证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
上海华信证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
民生证券有限责任公司	–	–	1,000,000,000.00	11.44%	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华创证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
首创证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
上海证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
新时代证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
北京高华证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国都证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东北证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东莞证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
广州证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
第一创业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
红塔证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
德邦证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中信万通证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
江海证券有限公司	–	–	–	–	–	–
西部证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东吴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长城证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
湘财证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华福证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
华安证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
西南证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华宝证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	–	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	–	–	–	–	–	–
瑞银证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中原证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华融证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国民族证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
渤海证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
日信证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
太平洋证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–

银华基金管理有限公司

2015年8月26日