银华-道琼斯88精选证券投资基金

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-道琼斯88精选证券投资基金
基金简称	银华-道琼斯88指数
基金主代码	180003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年8月11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	2,910,790,084.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将运用增强型指数化投资方法,通过严格的投资流程和数量化风险管理,在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金,以道琼斯中国88指数为基金投资组合跟踪的标的指数,股票指数化投资部分主要投资于标的指数的成份股票,增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票,在控制与标的指数偏离风险的前提下,力求取得超越标的指数的投资收益率。 本基金将不高于75%的资产投资于股票,将不低于20%的资产投资于国债。且保持不低于基金资产5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在法律环境允许后,本基金股票资产投资比例上限将调整为95%。
业绩比较基准	道琼斯中国88指数收益率
风险收益特征	1、与标的指数偏离的风险揭示:本基金采用的增强性投资策略将产生跟踪误差,基金的风险特征可能有别于指数本身。 2、基金价格变动风险提示:本基金因股票资产投资比例较大,当所追踪之标的指数因市场原因出现大幅下跌时,会造成基金资产净值的相应下跌,产生跌破基金发行价的风险。 3、更换标的指数风险提示:本基金管理人在本招募说明书规定的特定情况下有权更换标的指数,由此可能产生风险。

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

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1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	1,868,669,478.41
本期利润	873,378,016.61
加权平均基金份额本期利润	0.1720
本期加权平均净值利润率	15.55%
本期基金份额净值增长率	10.44%
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	391,207,266.54
期末可供分配基金份额利润	0.1344
期末基金资产净值	3,301,997,351.51
期末基金份额净值	1.1344
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	375.95%

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。

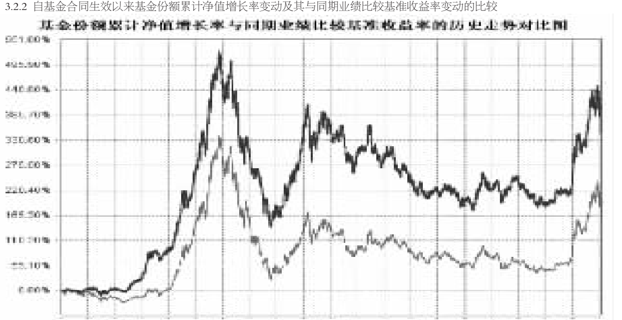
3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.50%	3.13%	-8.01%	3.49%	3.51%	-0.36%
过去三个月	1.55%	2.52%	5.24%	2.61%	-3.69%	-0.09%
过去六个月	10.44%	2.22%	14.47%	2.36%	-4.03%	-0.14%
过去一年	59.35%	1.83%	93.50%	1.98%	-34.15%	-0.15%
过去三年	49.76%	1.44%	65.43%	1.58%	-15.67%	-0.14%
自基金合同生效起至今	375.95%	1.56%	181.23%	1.81%	194.72%	-0.25%

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:本基金各项资产配置比例符合基金合同的规定:本基金将不高于95%的资产投资于股票,且保持不低于基金资产5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

§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、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		
陈秀峰先生	本基金的基金经理	2010年9月8日	-	13年	硕士学位。曾先后任职于中国民族国际信托投资公司、中国信息信托投资公司。2002年8月加盟银华基金管理有限公司,历任基金经理助理、投资部总监助理、投资部执行总监、机构理财部负责人、企业年金与机构理财部总监、特定资产管理部总监。具有从业资格。国籍:中国。
哈默女士	本基金的基金经理助理	2014年6月23日	2015年5月25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,自2015年5月25日起担任银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华惠增利货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金基金经理,自2015年7月16日起兼任银华货币市场证券投资基金及银华交易型货币市场基金基金经理。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-道琼斯88精选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,国内宏观经济表现较弱。CPI和PPI数据持续在低位,通缩的压力持续存在,并在政策间歇期阶段性强化。在经济下滑趋势明确的情况下,货币政策力度加大,不断释放流动性。同时,政府推动改革和创新的力度依然持续加强,政府极力维护经济不跌出合理区间的决心十分坚定。海外方面,美国经济数据经历了走强而后低于预期的过程,QE的实施进度预期也随之波动,带动原油和美元价格大幅波动;欧洲方面,经济复苏乏力,欧央行推行QE,希腊再次成为欧洲危机的导火索。

本基金认为,国内宏观经济的运行,既受到经济自身规律和真实潜在增速的影响,又受到转型方向和路径选择的影响。政府对经济政策的理性选择,使得国内宏观经济处于上有顶下有底的状况。与此同时,政府改革的决心已明确表达,市场对改革的预期逐渐展开。基于以上认识,本基金在报告期内重点配置了金融等低估值大盘蓝筹及消费、医药类个股,取得了预期的效果。

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1.1344元,本报告期份额净值增长率为10.44% ,同期业绩比较基准增长率为14.47%。

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,经济基本面仍然难有明显改善,货币与财政将进入再平衡阶段,权益类资产短期进入整理期。着眼中期趋势,我们判断权益类资产仍然存在投资机会,收益将更多的来自于业绩与逻辑兼具的优质标的。债券市场短期震荡概率较大,政策风转向稳增长加之债务置换规模增大,是短期制约长端下行的主要因素。但7月过后资金面边际趋松叠加经济数据不好,也给长端带来了些许动力,短期内在宽松确定的情况下,杠杆策略最优。中期关注美国经济复苏和加息,全球流动性边际收紧为资产价格带来的影响。

本基金下半年将采用积极防御的投资策略。权益投资将按3条主线进行操作:1)精选业绩稳健、质地优良的细分行业和公司;2)侧重次新版块的个股挖掘,寻找差异化的投资机会;3)继续关注国企改革主题板块。债券操作仍以持有为主,适度优化结构,积极参与波段。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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-道琼斯88精选证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	350,496,082.64	264,132,512.83
结算备付金	-	13,566,644.74
存出保证金	1,905,161.88	428,592.99
交易性金融资产	2,986,620,470.32	6,375,342,013.24
其中:股票投资	2,790,113,470.32	5,895,448,578.04
基金投资	-	-
债券投资	196,507,000.00	479,893,435.20
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	-	105,600,358.40
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,817,125.58	7,485,397.81
应收股利	-	-
应收申购款	1,905,098.37	6,140,073.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	233.25	233.25
资产总计	3,347,744,172.04	6,772,695,826.63

负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	37,466,123.45	42,940,025.45
应付管理人报酬	3,752,660.03	6,428,410.50
应付托管费	781,804.18	1,339,252.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,172,135.32	7,963,018.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	574,097.55	480,999.10
负债合计	45,746,820.53	59,151,705.83
所有者权益:		
实收基金	2,910,790,084.97	6,535,879,220.96
未分配利润	391,207,266.54	177,664,899.84
所有者权益合计	3,301,997,351.51	6,713,544,120.80
负债和所有者权益总计	3,347,744,172.04	6,772,695,826.63

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值为人民币1.1344元,基金份额总额为2,910,790,084.97份。

6.2 利润表

会计主体:银华-道琼斯88精选证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	930,746,699.29	-389,472,865.99
1.利息收入	7,501,775.62	10,546,087.43
其中:存款利息收入	1,211,316.30	1,102,607.47
债券利息收入	6,208,321.30	9,443,479.96
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	82,138.02	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,918,211,779.82	-34,478,784.66
其中:股票投资收益	1,906,843,885.94	-94,311,019.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-25,816,274.15	-11,214,629.62
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	37,184,168.03	71,046,864.18
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-995,291,461.80	-365,568,972.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	324,605.65	28,803.45
减:二、费用	57,368,682.68	46,203,888.06
1.管理人报酬	33,556,102.30	33,855,923.97
2.托管费	6,990,854.60	7,053,317.43
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	16,576,260.88	5,073,429.99
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	245,464.90	221,216.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	873,378,016.61	-435,676,754.05
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	873,378,016.61	-435,676,754.05

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华-道琼斯88精选证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	6,535,879,220.96	177,664,899.84	6,713,544,120.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	873,378,016.61	873,378,016.61
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)	-3,625,089,135.99	-659,835,649.91	-4,284,924,785.90
其中:1.基金申购款	169,603,035.95	18,324,319.25	187,927,355.20
2.基金赎回款	-3,794,692,171.94	-678,159,969.16	-4,472,852,141.10
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)	2,910,790,084.97	391,207,266.54	3,301,997,351.51
项目	**上年度可比期间 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)	8,271,660,496.87	-1,947,173,913.77	6,324,486,583.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-435,676,754.05	-435,676,754.05
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)	-500,667,249.50	144,354,998.77	-356,312,250.73
其中:1.基金申购款	93,275,208.31	-27,146,384.16	66,128,824.15
2.基金赎回款	-593,942,457.81	171,501,382.93	-422,441,074.88
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)	7,770,993,247.37	-2,238,495,669.05	5,532,497,578.32

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

除6.4.2.2会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外,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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布@<泄□と□蹲驶□鹨敌□峁乐岛怂愎ぶ餍〤楣赜? 015年1季度固定收益品种的估值处理标准@>耐ᗡ□返墓娑ǎ□? 015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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

7.4.6.1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。

7.4.6.2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。

7.4.6.3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、国家税务总局财税[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、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。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
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
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
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

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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	409,310,114.17	4.27%	223,504,110.32	6.70%
西南证券	165,766,673.70	1.73%	14,047,868.58	0.42%
第一创业	-	-	29,060,880.24	0.87%

6.4.5.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
西南证券	-	-	114,341,873.00	45.30%

6.4.5.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.5.1.4 权证交易

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权证交易。

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	372,634.80	4.27%	357,131.99	11.26%
西南证券	150,912.60	1.73%	-	-
关联方名称	**上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日**			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	203,478.05	6.70%	-	-
西南证券	12,789.18	0.42%	12,789.18	1.13%
第一创业	26,456.88	0.87%	-	-

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等)。

2、该类佣金协议的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。

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1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,556,102.30	33,855,923.97
其中:支付销售机构的客户维护费	4,613,723.88	4,812,007.45

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%/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,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,990,854.60	7,053,317.43

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,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

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:本基金于本报告期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。

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本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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:本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
建设银行	350,496,082.64	1,129,058.25	275,457,565.04	1,044,262.91

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。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

注: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。

6.4.6 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
600900	长江电力	2015年6月15日	重大资产重组	14.35	-	-	10,000	112,827.31	143,500.00	-

6.4.6.3 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。

6.4.7 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	2,790,113,470.32	83.34
	其中:股票	2,790,113,470.32	83.34
2	固定收益投资	196,507,000.00	5.87
	其中:债券	196,507,000.00	5.87
	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	350,496,082.64	10.47
7	其他各项资产	10,627,619.08	0.32
8	合计	3,347,744,172.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	983,180.00	0.03
C	制造业	117,951,700.00	3.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	213,200.00	0.01
E	建筑业	220,000.00	0.01
F	批发和零售业	397,500.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	842,400.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,775,050.32	0.08
J	金融业	2,060,439,340.00	62.40
K	房地产业	385,900.00	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	129,800.00	0.00
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	2,184,338,070.32	66.15

7.2.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	351,556,300.00	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,570,000.00	2.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	79,100.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	85,995,000.00	2.60
K	房地产业	80,575,000.00	2.44
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	605,775,400.00	18.35

7.3 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

7.3.1 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	600837	海通证券	8,000,000	174,400,000.00	5.28
2	601166	兴业银行	10,000,000	172,500,000.00	5.22
3	600036	招商银行	8,000,000	149,760,000.00	4.54
4	600000	浦发银行	8,000,000	135,680,000.00	4.11
5	601318	中国平安	1,600,000	131,104,000.00	3.97
6	000728	国元证券	3,150,000	119,637,000.00	3.62
7	000625	长安汽车	5,000,000	105,750,000.00	3.20
8	000001	平安银行	7,000,000	101,780,000.00	3.08
9	600015	华夏银行	6,500,000	98,865,000.00	2.99
10	601818	光大银行	18,000,000	96,480,000.00	2.92

注:投资者欲了解本报告期末基金指数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。

7.3.2 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	600276	恒瑞医药	4,000,000	178,160,000.00	5.40
2	600559	老白干酒	1,300,000	108,576,000.00	3.29
3	600674	川投能源	7,000,000	87,570,000.00	2.65
4	000712	锦龙股份	2,450,000	85,995,000.00	2.60
5	000046	泛海控股	5,500,000	80,575,000.00	2.44

注:投资者欲了解本报告期末基金积极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	600332	白云山	252,704,964.97	3.76
2	601166	兴业银行	214,121,234.48	3.19
3	000728	国元证券	178,580,663.06	2.66
4	600010	包钢股份	169,444,623.34	2.52
5	600060	海信电器	153,986,749.65	2.29
6	601628	中国人寿	153,103,264.32	2.28
7	600109	国金证券	148,090,754.45	2.21
8	600559	老白干酒	143,502,627.74	2.14
9	000001	平安银行	139,486,162.26	2.08
10	601318	中国平安	127,059,905.64	1.89
11	600674	川投能源	121,348,343.57	1.81
12	600999	招商证券	95,871,116.58	1.43
13	600104	上汽集团	94,303,839.83	1.40
14	600158	中体产业	84,019,380.66	1.25
15	601099	太平洋	82,277,547.31	1.23
16	601377	兴业证券	79,694,780.55	1.19
17	000776	广发证券	73,520,594.69	1.10
18	601601	中国太保	70,934,974.62	1.06
19	000895	双汇发展	68,870,047.77	1.03
20	000858	五 粮 液	67,543,003.58	1.01

注:"买入金额"按成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	461,841,769.23	6.88
2	600276	恒瑞医药	348,033,954.52	5.18
3	000625	长安汽车	307,034,287.43	4.57
4	601628	中国人寿	288,937,524.93	4.30
5	600030	中信证券	287,710,110.99	4.29
6	600332	白云山	251,387,235.64	3.74
7	000001	平安银行	247,111,626.04	3.68
8	600010	包钢股份	235,044,032.54	3.50
9	601166	兴业银行	232,309,655.41	3.46
10	600060	海信电器	204,596,496.02	3.05
11	000069	华侨城A	189,907,551.66	2.83
12	600837	海通证券	177,620,064.15	2.65
13	601299	中国北车	171,600,000.00	2.56
14	600104	上汽集团	170,467,825.95	2.54
15	600109	国金证券	166,451,721.08	2.48
16	600000	浦发银行	164,314,616.26	2.45
17	000333	美的集团	162,104,433.81	2.41
18	000596	古井贡酒	160,512,998.63	2.39
19	000402	金 融 街	146,371,818.54	2.18
20	000848	承德露露	136,879,277.86	2.04
21	600016	民生银行	135,006,052.74	2.01
22	000858	五 粮 液	134,691,318.53	2.01

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。

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	3,160,015,445.23
卖出股票收入(成交)总额	7,184,295,292.19

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	196,507,000.00	5.95
	其中:政策性金融债	196,507,000.00	5.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	196,507,000.00	5.95

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140352	14进出52	1,000,000	96,130,000.00	2.91
2	140223	14国开23	500,000	50,200,000.00	1.52
3	140443	14农发43	300,000	30,081,000.00	0.91
4	140230	14国开30	200,000	20,096,000.00	0.61

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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投资股指期货。

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。

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	1,905,161.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,817,125.58
5	应收申购款	1,905,098.37
6	其他应收款	233.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,627,619.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 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。

§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
212,614	13,690.49	5,723,978.75	0.20%	2,905,066,106.22	99.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:截至本报告期末,本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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(2004年8月11日)基金份额总额	1,085,604,444.01
本报告期期初基金份额总额	6,535,879,220.96
本报告期基金总申购份额	169,603,035.95
减:本报告期基金总赎回份额	3,794,692,171.94
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,910,790,084.97

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

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

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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	
华泰证券股份有限公司	3	1,485,906,064.20	15.49%	1,352,766.49	15.49%	-
东兴证券股份有限公司	2	1,284,140,094.92	13.39%	1,169,078.23	13.39%	-
海通证券股份有限公司	2	891,551,943.28	9.29%	811,666.66	9.29%	-
北京高华证券有限责任公司	1	622,493,322.92	6.49%	566,718.40	6.49%	-
华创证券有限责任公司	2	592,942,328.63	6.18%	539,815.42	6.18%	-
安信证券股份有限公司	3	498,146,376.74	5.19%	453,514.90	5.19%	-
国金证券股份有限公司	2	473,146,741.17	4.93%	430,752.35	4.93%	-
东北证券股份有限公司	3	409,310,114.17	4.27%	372,634.80	4.27%	-
长江证券股份有限公司	2	401,121,211.61	4.18%	365,178.37	4.18%	-
申万宏源集团股份有限公司	2	299,585,251.24	3.12%	272,741.36	3.12%	-
中信证券股份有限公司	3	291,539,996.66	3.04%	265,420.37	3.04%	-
光大证券股份有限公司	2	280,105,251.43	2.92%	255,008.35	2.92%	-
平安证券有限责任公司	2	270,715,488.01	2.82%	246,459.78	2.82%	-
日信证券有限责任公司	1	247,628,953.53	2.58%	225,441.27	2.58%	-
广发证券股份有限公司	2	188,944,265.12	1.97%	172,014.74	1.97%	-
东方证券股份有限公司	2	175,491,628.86	1.83%	159,767.50	1.83%	-
西南证券股份有限公司	1	165,766,673.70	1.73%	150,912.60	1.73%	-
长城证券有限责任公司	3	147,626,643.10	1.54%	134,399.83	1.54%	-
渤海证券股份有限公司	1	132,744,812.21	1.38%	120,851.94	1.38%	-
中国银河证券股份有限公司	1	128,916,021.95	1.34%	117,364.49	1.34%	-
华安证券股份有限公司	1	110,991,969.87	1.16%	101,047.81	1.16%	-
中信建投证券股份有限公司	1	102,095,441.64	1.06%	92,947.51	1.06%	-
湘财证券有限责任公司	1	89,840,264.45	0.94%	81,790.81	0.94%	-
兴业证券股份有限公司	3	80,815,308.53	0.84%	73,572.98	0.84%	-
中国中投证券有限责任公司	1	50,871,735.14	0.53%	46,313.70	0.53%	-
广州证券有限责任公司	1	50,064,869.24	0.52%	45,579.38	0.52%	-
新时代证券有限责任公司	1	46,537,991.51	0.49%	42,368.62	0.49%	-
国信证券股份有限公司	3	43,470,980.03	0.45%	39,576.03	0.45%	-
上海证券有限责任公司	1	29,364,040.32	0.31%	26,733.09	0.31%	-
红塔证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
凯盛	1	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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
华泰证券股份有限公司	337,806,659.50	60.95%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	216,473,858.20	39.05%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
日信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信万通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
凯盛	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

银华基金管理有限公司
2015年8月26日