### 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:2016年3月25日

2.1 基金基本情况 基金名称		átt fica	中深300指数分级证券投资基金				
基金節軟			平300指数分级				
加速用作 场内简称		300%					
基金主代码		16181					
基金运作方式		_	2开放式				
基金合同生效日			014年1月7日				
基金管理人			製华基金管理有限公司				
基金托管人		_	能设银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额		_	3,890.68(?)				
基金合同存续期		不定等					
基金份额上市的证券交易所		深圳证	E券交易所				
		2014-					
下属分级基金的基金简称		银华3	00A	银华300B	300分级		
下属分级基金的交易代码		15016	7	150168	161811		
报告期末下属分级基金份额总额		32,225	,744.00∯	32,229,744.00(9)	103,574,402.6819		
2.2 基金产品说明							
投资目标 本基金 值增长		水基金运用指数化投资方法,通过严格的投资流程的束和数量化风险管理手段,追求跟踪误差最小化,力争控制本基金的净 排骨长率与业绩比较基准之间的日均预踪编属度的绝对值不超过0.35%,年限龄误差不超过4%。					
投資策略的資		的指数 本 的资产	本基金美用程化化油样复制物的推致。就化油油物化铝钾硫化物理平台。使用组合性化力法由键投资组合、从高本规模形成的高温测验。 的线数的高温测验。 "在一个工程,是一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个一个一个工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个一工程,也可以是一个一个工程,也可以是一个一个一个工程,可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一个工程,也可以是一工程,也可				
业绩比较基准		95%×iF	等300指数收益率45%×商业银行	活期存款利率 (税后)。			
风险收益特征		币市场	木基金为复制指数的股票型基金,具有较高风险。较高预期收益的特征,其风险和预期收益為于混合型基金、债券型基金和 市市场基金。从本基金所分析的两类基金的额来看。很早300A份额具有低风险。收益相对稳定的特征:很早300B份额具有高 6。高限期收益的特征。				
下属分级基金的风险收益特征	E	低风险	氏风险、收益相对稳定。     高风险、高预期收益。		较高风险、较高预期收益。		
2.3 基金管理人和	基金托管人			'			
J	項目		基金管理人		基金托管人		
名称			银华基金管理有印	<b></b> 中	国建设银行股份有限公司		
	姓名		杨文辉		田青		
信息披露负责人	联系电话		(010)5816300	10	010 67595096		
	电子邮箱		yhjj@yhfund.com	n.cn	tianging1.zh@cch.com		
客户服务电话			4006783333,(010)83	5186558	010 67595096		
传真			(010)5816302	7	010 )66275853		
2.4 信息披露方式							
	2人互联网网址			http://www.yhfund.c	om.cn		
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 基金年度报告备置地点				http://www.yhfund.com.cn 基金管理人及基金杆管人住所			

		金额单位:人民币
1.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年1月7日(基金合同生效日)-2014年12月31日
<b></b> 期已实现收益	148,268,070.28	32,200,971.7
<b></b>	76,971,128.93	130,682,580.3
11权平均基金份额本期利润	0.2272	0.526
<b></b> 期加权平均净值利润率	21.26%	49.269
<b>以</b> 期基金份额净值增长率	1.43%	49.80
1.12 期末数据和指标	2015年末	2014年末
朋末可供分配利润	8,690,509.85	-105,709,171.9
別末可供分配基金份額利润	0.0517	-0.340
用末基金资产净值	160,892,966.96	453,656,543.6
用木基金份额净值	0.958	1.46
13 累计期末指标	2015年末	2014年末
医金份额累计净值增长率	51.94%	49.80

过去六个月	-17.41%	2.63%	-15.64%	2.54%	-1.77%	0.09
过去一年	1.43%	2.42%	5.70%	2.36%	-4.27%	0.069
自基金合同生效起至今	51.94%	1.87%	63.25%	1.86%	-11.31%	0.019
3.2.2 自基金合同		分额累计净值增加 产值·有长字。	《率变动及其与同 <b>同时则业统计</b>		放益率变动的比较 的历史是势对比	ki
1/24/19					A.	
400,0355				1 1	81	
96.2700				179	f W	
81 63%				1 1 1 1 1 1	No.	
78 97%				2	Mrs.	14.14
1017146	-			Miles of	7.44	THAT!
(0.02%			- A	19"	Live .	1.
41.22%			1		LAC.	
18075			mound			
6000	many	m	*****			
	200	NICAN I	23.40	4 4 5 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6 6	2000	# XC #
			uneames -	****		
汁 が甘ムム目6	白心甘水 空間的	せんムロルがわ	一人日子は人間	Zab ム thikt オロナタ T	高次立記 撃し 加口 4スケ	2040ABA02

自其金合何生效以來基金每年爭問相以十次次可可加速期比次為他以而十四年次 自其金合何生效以來基金每年賽值增长率及其有同關重量比较基準改量率的對比例 41,660 0.00

生,合同生效当年按实际存获期计算,不按整个自然年度进行所算。 3. 过去二年基金的利润介品情况 上,根据银华沪深300相数分级证券投资基金合同的约定,本基金(包括300分级份额、银华300A份额、银华300B份额)不进行收

姓名	即各	任本基金的基金经	理動理期限	证券从业年限	设即
X1.41	80.09	任职日期	高任日期	HESPONIES-PR	1091
周大鹏先生	本基金的基金经理	2014年1月7日	-	7年	制士学位、华田子中国、凡大学、2008年7月加盟银行企业管理有限公司管理的任何生活企业的任何生活企业的开放。 全部有限公司、即任任保生基金管理的管理,任3012年3月21日 等部研究及基金管理的管理。任3012年3月21日 全经理。任3012年3月3日起源任保产上1559年2月21日 经营理。任3012年3月3日起源任保产上1559年2日 2013年3月22日起源任保产中正安大股营定型组合公司 新数计经价格的企业等分级企业的信息。 1013年3月22日起源任保产中正安大股营定型组合公司 特别任金管理的企业等分级企业经营工程的企业。 1013年3月21日起源任保产工程的企业。

基金基金合同》和其他有关法律法规的规定。本着诚实信用、勤勉尽贵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

4.3.2 公平交易制度的执行情况 4.3.2 燃料价值况39 报告期内,本基金管理人根据《银华基金管理有限公司公平交易制度》及相关配套制度,在研究分析、投资决策、交易执行、业绩 评估等各个环节,建立了股金分数允平交易执行体系。公平对待据下的每一个投资组合。具体执行协议加下, 在研究分析环节。本基金管理人构建了统一的研究平台。为据下所有投资组合公平地提供研究支持 化投资效率环节。本基金管理、投资企理严格遵守本金管理人的各项投资管理制度和投资投发制度,保证各投资组合的独立 投资决策机制。

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整情形的说明 报告期内。本基金不存在查案二十个工作口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。 \$ 1 代码人现在 5 人名英格兰 (1915年)

5. 托管人报告期内本基金托管人遭毙守信情况声明 本报告期,中国键设银行股份有限公司在本基金的托管证明,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、不存在商基金份额指有人相信的行为、完全原现民步地履行了基金托管人以尽的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遭视守信。净值计算、利润分配等宿况的说明 本报告期,并任告人按照国客关策地。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管。未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。 报告期户、本基金未实施明分配。 5.3 托管人对本年度报告中财务信息与内容负填实、准确和完整发表意见 本托管人及转审查了和指导中财务信息与内容负填实、准确和完整发表意见 本托管人发标审查了和指导的财务指标、净值表现、共同分配情况、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、误导性矫定或者重大遗漏。

本基金2015年度财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文意看审计报告全文。 7.1 资产负债表 会计主体;银华沪深300指数分级证券投资基金 报告截止日;2015年12月31日

# 银华沪深300指数分级证券投资基金

## **2015** 年度 报告摘要

微 / <sup>th</sup>	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产;		
银行存款	9,061,354.19	34,577,617
结算备付金	130,048.95	195,761
存出保证金	70,991.17	33,833
交易性金融资产	152,377,480.06	429,621,114.
其中。股票投资	152,377,480.06	429,621,114
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	-	
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	-	3,911,344
应收利息	2,299.78	10,902.
应收股利	-	
应收申购款	26,496.79	1,157,297
递延所得税资产	-	
其他资产	-	
资产总计	161,668,670.94	469,507,872
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31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	-	
实出回购金融资产款	-	
应付证券清算款	-	
应付赎回款	115,353.53	14,205,103
应付管理人报酬	140,139.31	455,469
应付托管费	30,830.65	100,203
应付销售服务费	-	
应付交易费用	90,320.99	842,812
应交税费	-	
应付利息	-	
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	399,059.50	247,740
负债合计	775,703.98	15,851,328
所有者权益;		
实收基金	152,202,457.11	435,084,924
	8,690,509.85	18,571,619
<b>未分配利润</b>		
未分配利润 所有者权益合计	160,892,966.96	453,656,543

	本期	单位:人民币:
项目	本朝 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日
- 收人	83,997,076.28	136,437,776.42
利息收人	209,889.18	181,559.12
[中:存款利息收入	209,889.18	181,559.12
<b>等利息收入</b>	-	-
6产支持证券利息收人	-	
[人返售金融资产收入	-	
(他利息收人	-	
投资收益 额失以 ""填列)	154,311,053.52	37,070,017.28
[中:股票投资收益	149,516,042.18	31,939,280.77
E金投资收益	-	
<b>等</b> 投资收益	-	-
产支持证券投资收益	-	
金属投资收益	-	-
7生工具收益	-	
E利收益	4,795,011.34	5,130,736.51
公允价值变动收益 额失以""号填列)	-71,296,941.35	98,481,608.62
. 汇兑收益 {机失以*_*号填列 )	-	
其他收入 假失以 2"号填列)	773,074.93	704,591.40
此二、费用	7,025,947.35	5,755,196.05
管理人报酬	3,628,417.17	2,596,249.03
托管费	798,251.76	571,174.73
銷售服务费	-	
交易费用	1,963,470.59	1,997,664.53
利息文出	-	
[中;卖出回购金融资产支出	-	
其他费用	635,807.83	590,107.76
三、利润总额(亏损总额以 117号填列)	76,971,128.93	130,682,580.37
t:所得税费用	-	-
P、净利河 停亏损以 2.7号填列)	76,971,128.93	130,682,580.37

7.2 利润表 会计主体:银华沪深300指数分级证券投资基金

项目		本期 2015年1月1日至2015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 旣金净值)	435,084,924.61	18,571,619.03	453,656,543.6		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期 利润)	-	76,971,128.93	76,971,128.9		
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 停值减少以""号填列)	-282,882,467.50	-86,852,238.11	-369,734,705.6		
其中:1.基金申购款	409,670,660.42	36,932,553.78	446,603,214.2		
2.基金赎回款	-692,553,127.92	-123,784,791.89	-816,337,919.8		
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金 净值变动 停值减少以 1 写填列)	-	-			
五、期末所有者权益 舊金净值)	152,202,457.11	8,690,509.85	160,892,966.9		
项目	上年度可比期间 2014年1月7日(基金台同生效日)至2014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 舊金净值)	359,021,612.58	-109,080,388.88	249,941,223.7		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期 利润)	-	130,682,580.37	130,682,580.3		
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)	76,063,312.03	-3,030,572.46	73,032,739.5		
其中:1.基金申购款	791,200,635.67	-73,724,899.86	717,475,735.8		
2.基金赎回款	-715,137,323.64	70,694,327.40	-644,442,996.2		
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	_	-			
净值变动 停值减少以 = "号填列)					

定。 本納多根表以本基金特殊经营为基础列把 7-4.3 建商企业会计准则投入债有关规定的声明 未补劳税表符合企业会计准则发表,其实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净

7-45。全计数策和会计估计变更以及差错更正的说明
7-4.5。全计数策和会计估计变更以及差错更正的说明
7-4.5。全计数策和会计位数度更。
7-4.5。全计数许变更以及差错更正的说明
7-4.5。全计数许变更的说明
7-4.5。全计估计变更的说明
7-4.5。全计估计变更的说明
7-4.5。全计估计变更的说明
7-4.5。全计估计变更的说明
7-4.5。全计估计变更加速度
7-4.5。全计估计变更加速度
7-4.5。全计估计变更加速度
7-4.5。全部是
7-4

刀1%: 英国多院批准,財政部、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)交易印花税配率缴納印花 税,受让方年毎世代,税率不变;

所得稅: #抵謝政部。国家稅务总局,中国证监会财稅[2012]\$5号文(关于实施上市公司股息红利差别化个人所得稅政策有关问题的通 的規定。[2013年1月1日起,证券稅皆基金从公开按行和稅止市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以介含1个月,約,其 這有所得全部計入应納稅所得額。上於所得核一部在1月以上至1年(全日中)的"智被按50%計入应納稅所得額"持股期限超过1分 就25%計入应納稅所得額。上於所得核一部門20%的累計位个人所得稅。 就提到政部。国家稅金局,中国企金份稅[2015]的司令文(关于上市公司股包非形别化个人所得稅政策有关问题的细)的 8. 自2015年9月8日起,证券稅资基金从公开发行和稅上市场取得的上市公司股包非規則化个人所得稅政策有关问题的细)的 8. 自2015年9月8日起,证券稅资基金从公开发行和稅上市场取得的上市公司股包非規則化个人所得稅政策有关问题的细)的

12月31日	上年度可比期间 2014年1月7日(基金合同生效日)至20	]31⊟	本期 2015年1月1日至2015年12月	关联方名称	
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	成交金额	大統分合称	
4.75%	63,164,445.60	8.01%	93,896,234.86	南证券	
20.97%	278,666,877.43	2.30%	26,976,883.58	I-ONE	
3.96%	52,587,938.19	-	_	北证券	

注:本基金于本限告期及上年度可比期间2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。 74.81.3 债券回购交易 注:本基金产本报告期及上年度可比期间2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。 74.81.4 就应交易 注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行被运务。 注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年1月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

关联方名称		2015年1月	本期 日至2015年12月31日	
大联万石称	当期 何金	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
西南证券	85,939.68	8.03%	20,248.65	22,429
第一创业	24,580.19	2.30%	666.66	0.749
关联方名称		上: 2014年1月7日(基金	年度可比期间 合同生效日)至2014年12月31日	
AAAAA	当期 何金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金总额的比 例
东北证券	47,875.07	3.96%	47,875.07	5.689
	57,501.60	4.75%	8,129.52	0.969
西南证券			253.701.23	30.109

7.4.8.4.2 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 

关联方 名称

中國經歷F 90AL5349 19599025 19599025 19599025 19599025 124.8在 基基企在季期則內参与天联方案附進學的情况 注:本基金于本限計劃及上年度可比期间均率在季期期內参与天联方案 不基金本報告期及上年度可比期间均元需要说明的其他关联交易率项。 7-4.9 期末(3)第142月3日;为基金持有的流速变限证券 7-4.9 11以保險稅之增处证券前于期末持有的流速变限证券 7-4.9 11以保險稅之增处证券前于期末持有的流速变限证券

股票代码	股票名 称	停牌日期	停牌原 因	期末 估值单价	矩牌日期	矩牌 开盘单价	数量 優)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
000002	万 科A	2015年12月21日	重大事項	24.43	-	-	122,534	1,522,350.51	2,993,505.62	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事項	60.18	-	-	15,154	947,438.48	911,967.72	-
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事項	17.31	-	-	51,188	490,695.65	886,064.28	-
600271	航天信 息	2015年10月12日	重大事 項	71.46	-	-	11,115	374,076.23	794,277.90	-
601377	兴业证 券	2015年12月29日	重大事 項	11.00	2016年1月7日	9.40	64,113	861,931.07	705,243.00	-
601018	宁波港	2015年8月4日	重大事 項	8.16	2016年2月22日	7.34	85,177	378,278.33	695,044.32	-
600649	城投控 股	2015年12月30日	重大事 項	23.16	2016年1月7日	20.84	23,090	190,666.06	534,764.40	-
600690	青島海尔	2015年10月19日	重大事 項	9.92	2016年2月1日	8.93	49,499	481,780.25	491,030.08	-
002465	海格道 信	2015年12月30日	重大事項	16.69	2016年2月4日	15.02	26,462	309,900.61	441,650.78	-
000876	新香	2015年8月17日	重大事項	18.99	2016年3月2日	17.09	21,098	389,704.59	400,651.02	-
002065	东华钦 件	2015年12月22日	重大事項	25.10	-	-	12,353	258,663.49	310,060.30	-
600873	梅花生 物	2015年12月17日	重大事項	9.14	-	-	30,555	217,745.95	279,272.70	-
000796	凯撒旅 游	2015年11月9日	重大事 項	27.46	-	-	7,800	213,720.00	214,188.00	-
000712	領龙股 份	2015年12月25日	重大事 項	29.12	2016年1月4日	28.00	6,962	290,094.12	202,733.44	-
600783	鲁信创 投	2015年12月31日	重大事 項	39.07	2016年1月4日	37.60	4,627	129,783.71	180,776.89	-
600578	京能电 力	2015年11月5日	重大事 項	6.07	2016年2月24日	5.49	22,007	126,308.11	133,582.49	-
600986	科达股份	2015年12月14日	重大事項	21.00	-	-	11	257.05	231.00	-

单位:人民币元

本基金本报告期来书符目原实止即95.20911-1293371293729
7-4.10 有助于解释的分除计量按靠需要则明的其他市场
7-4.10 大价值
银行存就 结离合性。在出保证金、应付赎回款等,因其剩余期限不长、公允价值与账面价值相套。
(1)各层次金融工具公允价值
本基金本报告期来特有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币421,197,500.33元。属于第二层次的余额
民币8-423,644.26元,完酷于第三层公的余额。
(2)公允价值研展区次间的建立金融工具公允价值度次之间构集的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工
本基金数策分以报告期的行为确定金融工具公允价值层次之间构集的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工
基本等数策分以报告期的行为确定金融工具公允价值层次之间构集的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工
基本基金数策分以报告期的行为确定金融工员公允价值是次之间的集务数余金业协会值额有人民币448.398.72元。本基金本报告
招待日间上转投资金业协会中基协会位约404号(次下支布、中国市务投资金业协会值额第工作,组长于2015年1季度固定全线和基金等的分别分类。1945年12年度固定全域和基金等的分别分类。1945年12年度固定全域和基金等的分别分别,1945年2016年12月21日,1945年12年度固定全域和基金等的分别分别,1945年12年度固定全域和基金等的分别分别,1945年度国定全域和基金等的分别,1945年间,

序号	項目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	152,377,480.06	94.25
	其中:投票	152,377,480.06	94.25
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金雕衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中; 买新式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算各付金合计	9,191,403.14	5.69
7	其他各项资产	99,787.74	0.06
8	습计	161,668,670.94	100.00

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 & )
A	农.林.牧.通业	-	
В	采矿业	-	
С	制造业	-	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	
E	建筑业	231.00	0.0
F	批发和零售业	-	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	214,188.00	0.1
I	信息传输、软件和信息技术服务业	576,067.80	0.3
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	-	
0	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	790,486.80	0.4

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 注:本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

					金额单位:
序号	股票代码	股票名称	数量 優)	公允价值	占基金资产净值
1	601318	中国平安	166,920	6,009,120.00	
2	600016	民生银行	455,365	4,389,718.60	
3	601166	兴业银行	205,485	3,507,628.95	
4	000002	万 科A	122,534	2,993,505.62	
5	600036	招商银行	158,946	2,859,438.54	
6	600000	油发银行	143,710	2,625,581.70	
7	600030	中信证券	121,324	2,347,619.40	
8	601328	交通银行	362,849	2,336,747.56	
9	601398	工商银行	460,945	2,111,128.10	
10	600837	海道证券	124.731	1.973.244.42	

度报告止义。 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五名股票投资明细

8.4 报告	期内股票投资组	持有上述枳极投资股票。  合的重大变动 	20名的股票明细	
		.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 66)
1	601318	中国平安	14,117,052.02	3.11
2	600016	民生银行	10,763,587.00	2.37
3	601766	中国中年	9,000,442.96	1.98
4	600030	中信证券	7,405,592.00	1.63
5	600036	招商银行	7,267,034.00	1.60
6	600000	油发银行	7,264,388.23	1.60
7	601166	兴业银行	7,199,739.65	1.59
8	600837	海道证券	6,904,134.77	1.52
9	601988	中国银行	6,358,796.00	1.40
10	601328	risinings	5 176 935 72	1.14

-	000010	P-9-1-90-17	10,700,007.00	4-1
3	601766	中国中本	9,000,442.96	1.9
4	600030	中信证券	7,405,592.00	1.6
5	600036	招商银行	7,267,034.00	1.6
6	600000	油发银行	7,264,388.23	1.6
7	601166	兴业银行	7,199,739.65	1.5
8	600837	海道证券	6,904,134.77	1.5
9	601988	中国银行	6,358,796.00	1.4
10	601328	交通银行	5,176,935.72	1.1
11	601398	工商银行	5,010,574.83	1.1
12	000002	万 科A	4,964,093.81	1.0
13	601628	中国人寿	4,837,774.23	1.0
14	000166	中万宏源	4,648,301.32	1.0
15	000651	格力电器	3,841,177.65	0.8
16	601169	北京银行	3,748,952.33	0.8
17	601288	农业银行	3,651,250.00	0.8
18	601668	中国建筑	3,540,848.00	0.7
19	600637	东方明珠	3,441,692.32	0.7
20	601601	中国太保	3,308,161.78	0.7

				金额单位:人民币
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 (6.)
1	601318	中国平安	28,647,132.34	6.3
2	600016	民生银行	21,315,684.78	4.7
3	600036	招商银行	20,877,643.21	4.6
4	600030	中信证券	16,727,951.81	3.6
5	600000	油发银行	15,295,907.48	3.3
6	601166	兴业银行	14,812,897.40	3.2
7	600837	海道证券	14,205,320.78	3.1
8	601398	工商银行	10,791,607.98	2.3
9	000002	万 科A	10,475,263.08	2.3
10	601328	交通银行	8,969,335.15	1.9
11	601668	中国建筑	8,230,846.86	1.8
12	601766	中団中本	8,032,394.42	1.7
13	000651	格力电器	7,947,254.84	1.72
14	601601	中団太保	7,428,853.50	1.6
15	601818	光大银行	7,288,861.51	1.6
16	600887	伊利股份	7,259,575.04	1.6
17	600519	贵州茅台	7,140,063.59	1.5
18	601988	中団银行	7,101,135.35	1.5
19	000001	平安银行	7,044,911.99	1.5
20	601390	中国中铁	6,831,264.14	1.5

出现哪次、核立 20個 在: "完人股票成本总额" 和"卖出股票收入总额" 均按买卖成交金额(成交单价乘) 8.5 期末按偿缔品种分类的债券投资担合 注。本基金本保息期末未特有债息 8.6 期末按公介价值占基金资产净值比例大小非序的前五名债券投资明细 注。本基金本保息期末未特有60%,对 8.7 期末按公介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。本基金本保息期末未特有60%,支持证券。 8.8 报告期末按公介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。本基金本保全期末未转成等的

[2012] (北江)印》[27.5] 8.12.2 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。 8.12.3 期末其他各项资产构成

	91/19/416/19/94/ 19/44	单位:人民币元
序号	名称	金額
1	存出保证金	70,991.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,299.78
5	应收申购款	26,496.79
6	其他应收款	-
7	<b>待摊费用</b>	-
8	其他	-
9	合计	99,787.74
主:本是	期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	

91 期末基金份额持有人户数及持有人结构

	银华300		
序号	持有人名称	持有份額(份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	10,000,000.00	31.03
2	华能贵诚信托有限公司	3,432,891.00	10.65
3	尹爰勤	2,011,569.00	6.24
4	工银瑞信基金-农业银行-中油财务有限责任公司	1,790,797.00	5.56
5	X[4)15	1,379,815.00	4.28
6	海通资管-上海银行-海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划	1,329,394.00	4.12
7	欧藤虹	984,606.00	3.05
8	华夏基金-工商银行-华夏基金量化对冲1号资产管理计划	906,900.00	2.81
9	广发证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	842,353.00	2.61
10	余健鸿	803,400.00	2.49
	银华300	В	
序号	持有人名称	持有份額(份)	占上市总份额比例
1	许文广	2,500,000.00	7.76
2	方時	2,124,581.00	6.59
3	李祖平	1,440,891.00	4.47

§ 10 开放式基金份额变动

11.2 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

21 基金管理人的意大人事实。 本基金管理人于1964年4月10日录令令,改于期先自2015年4月15日初刊化基金管理人制总经理、代为银干餐杯长职务。 本基金管理人于2015年7月25日录会会。自2015年7月24日规则任务定理先生现在本基金管理人制度长、改于期先生自该日配不用代在餐客长职务。 本基金行民,2015年1月1日设存任金融业,现在5月75年7日建设银行设存任金金等国总会经理。 本基金行民,2015年1月1日设存任金融业,现在5月75年7日建设银行设存任金金等国总会经理。

	安都 股票交易 应支付波券商的佣金		単位:人民巾2			
券而名称	交易单元数量		片当期即更			备注
		成交金額	成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	195,927,656.87	16.71%	178,375.80	16.67%	-
华创证券有限责任公司	2	133,627,169.66	11.40%	123,436.44	11.53%	-
中信证券股份有限公司	3	120,226,254.04	10.26%	109,457.88	10.23%	-
西南证券股份有限公司	1	93,896,234.86	8.01%	85,939.68	8.03%	-
湘财证券股份有限公司	1	73,630,320.13	6.28%	67,033.19	6.26%	-
招商证券股份有限公司	2	65,300,717.94	5.57%	59,523.91	5.56%	-
光大证券股份有限公司 国泰君安证券股份有限	3	60,501,913.60	5.16%	55,209.85	5.16%	-
国参石安业券股份有限 公司	2	48,003,226.06	4.09%	43,706.14	4.08%	-
东方证券股份有限公司	2	46,741,478.00	3.99%	42,553.40	3.98%	-
渤海证券股份有限公司	1	38,399,138.87	3.28%	34,958.60	3.27%	-
安信证券股份有限公司	3	33,830,148.79	2.89%	30,804.73	2.88%	-
中万宏源集团股份有限	3	33.620.757.71	2.87%	30.631.11	2.86%	_
公司 第一创业证券股份有限						
公司	2	26,976,883.58	2.30%	24,580.19	2.30%	-
兴业证券股份有限公司	3	26,002,011.51	2.22%	23,671.85	2.21%	-
中奉证券股份有限公司	1	25,964,255.34	2.21%	23,637.91	2.21%	-
广州证券股份有限公司	1	24,117,411.35	2.06%	21,958.78	2.05%	-
东吴证券股份有限公司	3	23,021,311.71	1.96%	21,439.96	2.00%	新增2个交易单 元
中国中投证券有限责任 公司	1	22,528,626.35	1.92%	20,508.93	1.92%	-
华泰证券股份有限公司	5	15,105,373.81	1.29%	13,751.65	1.28%	新增2个交易单 元
广发证券股份有限公司	2	13,694,106.29	1.17%	12,465.38	1.16%	76
中国银河证券股份者限	1	12,399,367.28	1.06%	11.288.31	1.05%	_
公司 民生证券股份有限公司	,	9 007 448 11	0.77%	8 195 55	0.77%	_
民主证券股份有限公司 国信证券股份有限公司	3	9,002,448.11 6,755,303.00	0.77%	8,195.55 6,148.07	0.77%	-
国金证券股份有限公司	2	6,755,303.00	0.58%	6,148.07	0.57%	-
中国国际金融有限公司	2	5,858,991.78	0.50%	5,456.59	0.51%	-
						_
中国民族证券有限责任 公司	1	5,361,541.38	0.46%	4,881.13	0.46%	-
华宝证券有限责任公司	1	3,416,359.00	0.29%	3,110.32	0.29%	-
海通证券股份有限公司	2	1,088,528.18	0.09%	991.01	0.09%	-
方正证券股份有限公司	5	600,343.40	0.05%	558.99	0.05%	新增4个交易单 元
江海证券有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-		-	-
中信证券 (山东)增限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
翻时代证券股份有限公 司	2	_	-	-	-	新增1个交易单 元
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	_	_	_	_	-
上海证券有限责任公司	1				_	_
东北证券股份有限公司	3	_	_	_		-
华安证券股份有限公司	1	_		_	_	-
中原证券股份有限公司	2	-	-	_	-	-
东莞证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中報団际证券有限责任	2	_	-	_	_	_
公司 华融证券股份有限公司	1		_		_	_
国都证券股份有限公司	2	_		_	_	-
中信建投证券股份有限	1	_		_	_	
公司 德邦证券股份有限公司	1			-	-	-
等福证券有限责任公司	1	-		-	-	-
		-			-	
开源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新増1个交易単 元
日信证券有限责任公司	1	-			-	-
上海华信证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

银华基金管理有限公司 2016年3月25日