银华中小盘精选混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中小盘混合
交易代码	180031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	706,036,972.86份
投资目标	依托中国资本市场层次、市场结构和市场功能的不断完善,通过投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,力求在有效控制投资组合风险的前提下,寻求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为主动式投资管理的混合型基金,根据对宏观经济发展阶段、政府政策引导方向、行业周期状况的考察,综合评价各类资产的风险收益水平,对各类资产采取主动、适度配置,在重点投资于具有高成长的中小盘股票的前提下实现大类资产配置,以求基金资产在权益类资产、固定收益类资产及其他金融工具的投资中实现风险-收益的最佳匹配。 本基金的资产配置比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于中小盘股票的资产不低于股票资产的80%;固定收益类资产占基金资产的比例为0%-35%;权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%;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%。
业绩比较基准	天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+中债总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的基金产品。本基金将力求在严格控制风险的前提下实现较高的投资收益。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	110,903,464.22
2.本期利润	154,514,687.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2111
4.期末基金资产净值	2,027,538,619.38
5.期末基金份额净值	2.872

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.上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的申购、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 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	7.93%	1.42%	0.14%	1.16%	7.79%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于中小盘股票的资产不低于股票资产的80%;固定收益类资产占基金资产的比例为0%-35%;权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%;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%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓星先生	本基金的基金经理	2015年7月7日	-	4年	硕士学位,2006年至2010年期间任职于ABB有限公司,历任运营发展部运营顾问、集团审计部高级审计师等职务;2011年2月加盟银华基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理职务。具有从业资格。国籍:中国。
王华先生	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资管理一部总监及A股基金投资总监。	2013年8月6日	2016年7月8日	14年	经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。曾在西南证券有限责任公司任职。2000年10月加盟银华基金管理有限公司(筹),先后在研究策划部、基金经理部工作。曾于2004年3月2日至2007年1月30日任银华保本增值证券投资基金基金经理,于2005年6月9日至2006年10月21日期间任银华货币市场证券投资基金基金经理,自2006年11月16日至2013年11月4日期间任银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理,自2014年12月12日起兼任银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理,自2016年7月8日起兼任银华优质增长混合型证券投资基金基金经理。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 管理人对投资组合管理遵守信息披露情况的说明

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》及其各项实施细则、《银华中小盘精选混合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的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,本基金管理人所有投资组合不存在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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场结构化态显著,尽管指数并没有上涨,但优质的成长股在二季度有显著的超额收益。市场投资的情绪经历了较大波动,从季度初的极度悲观逐渐转变为适度乐观,新能源电动车、半导体电子、稀土永磁等子版块涨幅居前,给参与的投资人带来了不错的回报,市场逐渐出现赚钱效应。我们在二季度维持了较高的仓位,坚定持有了新兴行业中优质的上市公司,取得了不错的回报。截止到二季度末,我们的仓位主要配置在清洁能源、国防军工、信息技术、医药生物和消费升级等行业。

在英国退欧的恐慌情绪释放之后,全球股市和大宗商品的大幅反弹则反映了投资者风险偏好的明显改善,投资者已将英国退欧对于全球经济及政治的长期影响放在了一边,改为关注各国央行将再度展开的货币宽松政策。展望2016年三季度,在全球动荡的背景下,稳定的中国将成为资金的避风港,在全球范围来看,A股有望取得较大的超额收益。我们保持谨慎乐观预期市场或将震荡上行,景气度上行的行业将获得市场的青睐,我们继续看好新兴行业中的清洁能源、国防军工、信息技术、医药生物和消费升级等行业。

4.5 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2.872元,本报告期份额净值增长率为7.93%,同期业绩比较基准收益率为0.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,700,383,013.32	80.96
	其中:股票	1,700,383,013.32	80.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	347,002,269.45	16.52
8	其他资产	52,796,883.12	2.51
9	合计	2,100,182,165.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	40,184,838.00	1.98
B	采矿业	133,244,110.77	6.57
C	制造业	1,184,110,059.45	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,282,912.45	0.90
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,168,304.42	5.14
G	交通运输、仓储和邮政业	30,274,994.35	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,072,584.20	3.01
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	104,134,128.30	5.14
N	水利、环境和公共设施管理业	22,742,211.52	1.12
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	2,168,869.86	0.11
S	综合	-	-
	合计	1,700,383,013.32	83.86

5.2.2 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投资股票投资。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300095	华伍股份	9,493,485	125,408,936.85	6.19
2	300008	天海防务	3,127,151	104,134,128.30	5.14
3	002335	科华恒盛	1,741,223	84,484,139.96	4.17
4	603766	隆鑫通用	4,116,107	83,227,683.54	4.10
5	300408	三环集团	4,604,215	82,691,701.40	4.08
6	603020	爱普股份	3,590,725	82,191,695.25	4.05
7	002422	科伦药业	5,219,736	80,436,131.76	3.97
8	002594	比亚迪	1,151,813	70,272,111.13	3.47
9	600721	*ST百花	3,913,038	70,160,771.34	3.46
10	300089	文化长城	5,608,018	69,090,781.76	3.41

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券包括同花顺(证券代码300033)

根据浙江核新同花顺网络信息股份有限公司于2015年8月18日发布的公告,于近日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对同花顺的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余几名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,600,973.07
2	应收证券清算款	48,459,659.22
3	应收股利	-
4	应收利息	57,447.39
5	应收申购款	1,678,803.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,796,883.12

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	743,593,591.36
报告期期间基金总申购份额	26,697,448.07
减:报告期期间基金总赎回份额	64,254,066.57
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	706,036,972.86

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准银华中小盘精选股票型证券投资基金募集的文件

9.1.2《银华中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《银华中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》

9.1.4《银华中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》

9.1.5《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.yhfund.com.cn)查阅。

银华基金管理有限公司
2016年7月19日

银华中国梦30股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月19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2016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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中国梦30股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,820,546,349.63份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	60,998,605.82
2.本期利润	94,315,437.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0514
4.期末基金资产净值	1,584,766,657.15
5.期末基金份额净值	0.870

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.上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的申购、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 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	6.23%	1.52%	-1.33%	1.06%	7.56%	0.46%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定:本基金所持有的股票占基金资产的比例为80%-95%;其中投资于本基金界定的符合"新战略、新模式、新发展"的30只上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,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%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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 管理人对投资组合管理遵守信息披露情况的说明

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》及其各项实施细则、《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的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,本基金管理人所有投资组合不存在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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,我们运用自行开发的投资管理系统,结合量化投资技术和基本面分析对投资组合进行积极的管理和风险控制。本报告期内,市场风格切换频繁,投资者风险偏好明显提升,在经济基本面不佳的背景下,市场对于"新战略、新模式、新发展"的30只上市公司股票的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。

展望2016年第三季度,我们认为全球经济增长依然乏力,货币宽松的预期一直存在。2016年的美国经济基本面依然是最好的,但是受到其他国家和地区增速下滑的影响,美联储持续加息已经不太现实。中国经济在稳健宽松货币政策支持下,供给侧改革稳步推进,效果逐渐显现。在美联储持续加息不可能的背景下,人民币汇率不存在持续大幅贬值的可能,因此我们认为第三季度的经济增速有望保持稳定。

展望2016年第三季度的股票市场,从风险偏好以及行业景气两个层面来看市场,我们认为存在较好的投资机会。美国"脱欧"这一事件增强了全球货币政策的协调性,美联储加息的预期延后,人民币汇率有限的贬值成为市场可接受的状况,市场的风险偏好发生了积极的变化,其他风险因素的释放也有助风险偏好的提升,有利于整个市场的发展。从行业景气角度看,很多行业仍然保持着较高的行业景气,提供较强的结构性机会,这些行业包括但不限定于智能辅助驾驶、白酒、家电、OLED、物联网以及受益于供给侧改革的一些传统行业。我们相信抓住这种结构性的机会,同时享受市场风险偏好提升带来的收益。

展望本基金未来的操作,我们将根权衡风险和收益,调整仓位结构,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,实现基金资产的保值增值。

4.5 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0.870元,本报告期份额净值增长率为6.23%,同期业绩比较基准收益率为-1.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,412,245,050.22	87.07
	其中:股票	1,412,245,050.22	87.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	208,457,040.21	12.85
8	其他资产	1,282,420.12	0.08
9	合计	1,621,984,510.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	31,543,460.22	1.99
B	采矿业	28,299,827.70	1.79
C	制造业	906,097,873.16	57.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	63,176,425.95	3.99
F	批发和零售业	49,652,910.72	3.13
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	240,412,202.92	15.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	61,151,181.14	3.86
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	22,872,123.12	1.44
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	9,039,045.29	0.57
S	综合	-	-
	合计	1,412,245,050.22	89.11

5.2.2 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投资股票投资。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002303	美盈森	7,046,302	86,599,051.58	5.46
2	300033	同花顺	1,006,838	82,006,955.10	5.17
3	002463	沪电股份	13,975,043	73,788,227.04	4.66
4	600298	安琪酵母	3,874,047	69,112,998.48	4.36
5	600519	贵州茅台	229,394	66,964,696.48	4.23
6	002590	万安科技	2,107,450	65,604,918.50	4.14
7	002456	欧菲光	2,197,141	64,815,659.50	4.09
8	002385	大北农	7,955,226	64,119,121.56	4.05
9	000858	五粮液	1,968,267	64,027,725.51	4.04
10	002008	大族激光	2,801,285	63,981,349.40	4.04

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券中包括同花顺(证券代码300033)

根据浙江核新同花顺网络信息股份有限公司于2015年8月18日发布的公告,于近日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对同花顺的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余几名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,006,019.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,290.42
5	应收申购款	230,110.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,282,420.12

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,844,919,745.69
报告期期间基金总申购份额	21,007,075.86
减:报告期期间基金总赎回份额	45,380,471.92
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,820,546,349.63

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 银华中国梦30股票型证券投资基金基金募集申请获中国证监会注册的文件

9.1.2《银华中国梦30股票型证券投资基金基金合同》

9.1.3《银华中国梦30股票型证券投资基金招募说明书》

9.1.4《银华中国梦30股票型证券投资基金托管协议》

9.1.5《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.yhfund.com.cn)查阅。

银华基金管理有限公司
2016年7月19日

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中证800等权重指数增强分级	
场内简称	800分级	
交易代码	161825	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月5日	
报告期末基金份额总额	47,427,697.18份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证800等权重指数进行有效跟踪的基础上,通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金以中证800等权重指数为目标指数,在有效复制目标指数的基础上,结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。 当预期成份股发生调整、成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的中购和赎回对本基金跟踪中证800等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况(比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-95%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于中证800等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。	
业绩比较基准	95%×中证800等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)	
风险收益