

# 银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 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 2019 年 8 月 22 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 2019 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	银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金		
基金简称	银华中证等权 90 指数分级		
场内简称	90 分级		
基金主代码	161816		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 3 月 17 日		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
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	166,651,036.90 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 4 月 8 日		
下属分级基金的基金简称	中证 90A	中证 90B	90 分级
下属分级基金的交易代码	150030	150031	161816
报告期末下属分级基金份额总额	18,586,880.00 份	18,586,880.00 份	129,477,276.90 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争对中证等权重 90 指数进行有效跟踪,并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内,以分享中国经济的持续、稳定增长成果,实现基金资产的长期增值。		
投资策略	<p>本基金采用完全复制法,按照成份股在中证等权重 90 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证等权重 90 指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证等权重 90 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,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>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%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证等权重 90 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;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。</p>		
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证等权重 90 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$ 。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,银华中证 90A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征;银华中证 90B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	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	tianqingl.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	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	2,032,488.18
本期利润	29,120,770.92
加权平均基金份额本期利润	0.1711
本期加权平均净值利润率	18.15%
本期基金份额净值增长率	20.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-14,793,845.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0888
期末基金资产净值	161,904,922.56
期末基金份额净值	0.972
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	-8.16%

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	5.77%	1.10%	5.32%	1.10%	0.45%	0.00%
过去三个月	-4.24%	1.53%	-5.39%	1.54%	1.15%	-0.01%
过去六个月	20.75%	1.54%	19.86%	1.56%	0.89%	-0.02%
过去一年	6.28%	1.50%	3.16%	1.52%	3.12%	-0.02%
过去三年	4.68%	1.11%	0.54%	1.12%	4.14%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-8.16%	1.44%	-10.68%	1.43%	2.52%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中证等权重 90 指数收益率×95%+商业银行人民币活期存款利率（税

后) × 5%。

由于本基金投资标的指数为中证等权重 90 指数,且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%,因此,本基金将业绩比较基准定为  $95\% \times \text{中证等权重 90 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率 (税后)}$ 。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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投资比例已达到基金合同规定: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%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证等权重 90 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;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。

## § 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 2.222 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 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业股份有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。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。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 115 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、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (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、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、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、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)、银华交易型货币市场基金、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、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券

型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华安享短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。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		
张凯先生	本基金的 基金经理	2012 年 11 月 14 日	-	9 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据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 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华深证 100 交易型开放式指数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合规性情况的说明

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》、《公开募集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、《银华中证等权重 90 指数分级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 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,本基金管理人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

在报告期内,我们积极改进自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽

管报告期间本基金多次发生大额申购赎回，我们仍将跟踪误差控制在合理水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.972 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.75%，业绩比较基准收益率为 19.86%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 之内，年化跟踪误差控制在 4% 之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中，随着减税降费政策的逐步落地、社融数据的强劲以及市场风险偏好的修复，A 股市场在一季度经历了一次大幅度的反弹，随后在二季度进入震荡期。尽管宏观经济仍然呈现弱平衡的格局，市场的整体活跃度却相对去年有明显的改善。从行业层面来看，食品饮料、非银行金融、农林牧渔等行业收益靠前，建筑、传媒、汽车等行业收益相对落后。

展望下半年我们认为，随着科创板的推出与政策环境的宽松，A 股市场仍将持续存在投资机会。从板块上来看，我们认为随着稳增长政策的逐步落地，市场活跃板块较上半年可能会有所切换。短期的风险点仍然在海外，尤其是欧洲和美国的经济不确定性导致海外市场的调整。但从长期来看，随着国内经济新旧动能转换、居民整体收入水平提升与消费升级，投资者风险偏好有望逐步提升，带来市场持续投资机会。在此过程中，我们继续看好龙头类公司的超额收益。

#### 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验。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

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括银华 90 份额、中证 90A 份额、中证

90B 份额) 不进行收益分配。

#### 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关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: 银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

报告截止日: 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>		
银行存款	9,485,343.00	11,566,914.24
结算备付金	-	-
存出保证金	5,647.08	1,831.81
交易性金融资产	153,043,844.97	129,358,803.64
其中: 股票投资	153,043,844.97	129,358,803.64
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,929.05	2,622.67
应收股利	-	-
应收申购款	1,963.75	8,400.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	162,538,727.85	140,938,572.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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	41,335.48	5,187.57
应付管理人报酬	128,599.39	123,667.48
应付托管费	28,291.87	27,206.84
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	47,158.95	45,377.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	388,419.60	600,347.33
负债合计	633,805.29	801,786.34
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	176,698,767.99	184,555,584.46
未分配利润	-14,793,845.43	-44,418,798.27
所有者权益合计	161,904,922.56	140,136,786.19
负债和所有者权益总计	162,538,727.85	140,938,572.53

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，银华 90 份额净值为人民币 0.972 元，中证 90A 份额净值为人民币 1.024 元，中证 90B 份额净值为人民币 0.920 元；基金份额总额为 176,698,767.99 份，其中银华 90 份额为 129,477,276.90 份，中证 90A 份额为 18,586,880.00 份，中证 90B 份额为 18,586,880.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	30,328,482.24	-33,139,424.86
1.利息收入	36,001.43	42,287.11
其中：存款利息收入	36,001.43	42,287.11
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,148,519.83	-1,125,027.57
其中：股票投资收益	1,813,527.26	-2,500,405.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	1,334,992.57	1,375,377.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	27,088,282.74	-32,067,837.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	55,678.24	11,153.19
<b>减：二、费用</b>	1,207,711.32	1,497,266.82
1. 管理人报酬	793,636.18	958,155.34
2. 托管费	174,600.01	210,794.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	91,501.74	114,933.61
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	147,973.39	213,383.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	29,120,770.92	-34,636,691.68
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	29,120,770.92	-34,636,691.68

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	184,555,584.46	-44,418,798.27	140,136,786.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,120,770.92	29,120,770.92
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）	-7,856,816.47	504,181.92	-7,352,634.55
其中：1.基金申购款	676,947.20	-76,717.26	600,229.94
2.基金赎回款	-8,533,763.67	580,899.18	-7,952,864.49
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）	176,698,767.99	-14,793,845.43	161,904,922.56
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	200,017,012.75	9,275,133.49	209,292,146.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,636,691.68	-34,636,691.68
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）	-12,901,394.92	-444,064.67	-13,345,459.59
其中：1.基金申购款	1,940,904.50	18,534.83	1,959,439.33
2.基金赎回款	-14,842,299.42	-462,599.50	-15,304,898.92
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）	187,115,617.83	-25,805,622.86	161,309,994.97

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	_____ 凌宇翔	_____ 伍军辉
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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

无。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.3 税项

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.3.3 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。

#### 6.4.3.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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；

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、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利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

本基金管理人于 2019 年 4 月 13 日发布《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称及住所变更的公告》，公司全资子公司（原银华财富资本管理（北京）有限公司）已完成名称及住所变更，并已办理变更工商登记。名称变更为“银华资本管理（珠海横琴）有限公司”，住所变更为“珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-67069（集中办公区）”。

#### 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
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设”）	基金托管人、基金代销机构

银行” )	
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
第一创业	870,418.15	1.50%	29,068,220.28	40.57%

##### 6.4.5.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.5.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 6.4.5.1.4 权证交易

注：无。

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
第一创业	810.66	1.50%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
第一创业	27,071.07	40.73%	27,071.07	48.66%

### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	793,636.18	958,155.34
其中：支付销售机构的客户维护费	203,120.70	242,207.34

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	174,600.01	210,794.19

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 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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：无。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

注：无。

**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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	9,485,343.00	35,526.98	10,813,965.27	41,834.28

**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：无。

**6.4.5.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.6 期末（2019 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

**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
600485	*ST 信威	2019 年 2 月 11 日	重大事件停牌	7.22	2019 年 7 月 12 日	13.86	183,273	2,547,340.00	1,323,231.06	-

**6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无。

**6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 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	153,043,844.97	94.16
	其中：股票	153,043,844.97	94.16
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	9,485,343.00	5.84
8	其他各项资产	9,539.88	0.01
9	合计	162,538,727.85	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境内股票投资组合**

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	1,521,754.96	0.94
B	采矿业	6,465,159.64	3.99
C	制造业	66,148,704.79	40.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	6,530,372.22	4.03
F	批发和零售业	1,696,537.36	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	3,509,097.51	2.17

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,729,670.42	4.16
J	金融业	43,971,172.05	27.16
K	房地产业	6,449,279.65	3.98
L	租赁和商务服务业	3,422,664.27	2.11
M	科学研究和技术服务业	3,374,635.28	2.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,631,264.95	1.01
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	151,450,313.10	93.54

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	103,436.35	0.06
C	制造业	1,416,621.82	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
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	-	-
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	1,593,531.87	0.98

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 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	000776	广发证券	256,198	3,520,160.52	2.17
2	601398	工商银行	553,806	3,261,917.34	2.01
3	601688	华泰证券	95,799	2,138,233.68	1.32
4	000568	泸州老窖	23,274	1,881,237.42	1.16
5	600030	中信证券	78,746	1,874,942.26	1.16
6	300122	智飞生物	43,303	1,866,359.30	1.15
7	000858	五粮液	15,747	1,857,358.65	1.15
8	601888	中国国旅	20,815	1,845,249.75	1.14
9	002230	科大讯飞	55,284	1,837,640.16	1.14
10	600837	海通证券	127,633	1,811,112.27	1.12

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。

### 7.3.2 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	600485	*ST 信威	183,273	1,323,231.06	0.82
2	600968	海油发展	29,137	103,436.35	0.06
3	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.05
4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02

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	601398	工商银行	1,802,106.00	1.29
2	600031	三一重工	1,662,185.00	1.19
3	600837	海通证券	1,635,287.00	1.17
4	300498	温氏股份	1,631,992.00	1.16
5	300003	乐普医疗	1,626,402.00	1.16
6	601319	中国人保	1,624,965.00	1.16
7	601111	中国国航	1,621,840.00	1.16
8	000538	云南白药	1,612,066.00	1.15
9	300760	迈瑞医疗	1,580,905.00	1.13
10	601066	中信建投	1,511,162.00	1.08
11	300072	三聚环保	625,237.18	0.45
12	600703	三安光电	586,587.00	0.42
13	002456	欧菲光	465,488.00	0.33
14	002466	天齐锂业	442,667.00	0.32
15	601186	中国铁建	375,839.00	0.27
16	300070	碧水源	371,755.00	0.27
17	603259	药明康德	351,229.00	0.25
18	601138	工业富联	341,290.00	0.24
19	300750	宁德时代	340,538.00	0.24
20	601766	中国中车	321,775.00	0.23

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.2 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	600547	山东黄金	1,870,268.58	1.33
2	000839	中信国安	1,741,778.18	1.24
3	300024	机器人	1,669,030.76	1.19
4	600606	绿地控股	1,662,720.14	1.19
5	601006	大秦铁路	1,604,009.36	1.14



6	000709	河钢股份	1,533,048.46	1.09
7	601169	北京银行	1,489,238.04	1.06
8	601360	三六零	1,453,699.11	1.04
9	000858	五粮液	1,352,341.69	0.97
10	000568	泸州老窖	862,843.85	0.62
11	000338	潍柴动力	809,374.14	0.58
12	000063	中兴通讯	744,119.28	0.53
13	600519	贵州茅台	712,895.00	0.51
14	002475	立讯精密	651,674.91	0.47
15	000651	格力电器	634,031.87	0.45
16	300017	网宿科技	575,489.89	0.41
17	002142	宁波银行	517,391.58	0.37
18	600887	伊利股份	482,639.15	0.34
19	000333	美的集团	463,247.55	0.33
20	601888	中国国旅	382,734.93	0.27

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	27,064,815.09
卖出股票收入（成交）总额	32,281,583.76

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

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。

**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	5,647.08
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,929.05
5	应收申购款	1,963.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,539.88

**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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	*ST 信威	1,323,231.06	0.82	重大事项停牌
2	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	新股锁定

**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

份额级别	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
中证 90A	1,281	14,509.66	16,223,584.00	87.29%	2,363,296.00	12.71%
中证 90B	4,283	4,339.69	516,015.00	2.78%	18,070,865.00	97.22%
90 分级	10,804	11,984.20	4,881,833.92	3.77%	124,595,442.98	96.23%
合计	16,368	10,181.51	21,621,432.92	12.97%	145,029,603.98	87.03%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

**8.2 期末上市基金前十名持有人**

中证 90A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	瑞士信贷（香港）有限公司	11,573,544.00	62.27%
2	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	2,494,742.00	13.42%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	2,150,025.00	11.57%
4	#朱洪宏	557,237.00	3.00%
5	洪合作	162,313.00	0.87%
6	林秀	154,158.00	0.83%
7	中国银河证券股份有限公司客户信	113,837.00	0.61%

	用交易担保证券账户		
8	翁思杰	66,288.00	0.36%
9	欧贤茂	65,131.00	0.35%
10	吴艺	35,400.00	0.19%

## 中证 90B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	朱洪宏	884,231.00	4.76%
2	顾轶清	650,301.00	3.50%
3	张柏岩	557,598.00	3.00%
4	何静	423,897.00	2.28%
5	郁晓辉	325,290.00	1.75%
6	李丽琴	260,170.00	1.40%
7	欧贤茂	248,564.00	1.34%
8	王雅凤	239,546.00	1.29%
9	王燕芬	222,542.00	1.20%
10	倪己龙	218,193.00	1.17%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供；

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中证 90A	96.00	0.00%
	中证 90B	0.00	0.00%
	90 分级	0.00	0.00%
	合计	96.00	0.00%

## 8.4 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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 90A	中证 90B	90 分级
基金合同生效日(2011 年 3 月 17 日)	777,822,128.00	777,822,128.00	1,684,736,759.21
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	18,853,307.00	18,853,307.00	131,054,928.36
本报告期期间基金总申购份额	-	-	638,402.85
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	8,048,434.19
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-266,427.00	-266,427.00	5,832,379.88
本报告期末基金份额总额	18,586,880.00	18,586,880.00	129,477,276.90

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

## § 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
光大证券股份有限公司	2	25,268,226.29	43.41%	23,532.50	43.53%	—
申万宏源集团股份有限公司	3	23,339,974.25	40.10%	21,736.45	40.21%	—
中信建投证券股份有限公司	1	3,819,751.67	6.56%	3,557.33	6.58%	—
国信证券股份有限公司	3	2,083,473.13	3.58%	1,940.30	3.59%	—
华创证券有限责任公司	2	1,596,443.40	2.74%	1,486.74	2.75%	—
第一创业证券股份有限公司	2	870,418.15	1.50%	810.66	1.50%	—
方正证券股份有限公司	5	735,105.31	1.26%	537.53	0.99%	—
长城证券股份有限公司	3	489,447.69	0.84%	455.81	0.84%	—
东兴证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
东莞证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
北京高华证券有限责任	1	—	—	—	—	—

公司						
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	2	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券（山 东）有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	3	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
德邦证券股	1	-	-	-	-	-



份有限公司						
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	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等。

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
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有	-	-	-	-	-	-

限责任公司						
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20% 的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2019 年 6 月 21 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，本基金属于本基金管理人旗下可投资科创板股票的基金之一。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

银华基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 26 日

