

银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 2016 年 3 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	53
8.7 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.....	53

8.8 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	53
8.9 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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3 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	54
§10 开放式基金份额变动	54
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华高端制造业混合
基金主代码	000823
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 13 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	481,695,423.34 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选高端制造行业的优质上市公司进行投资，积极把握中国制造业的产业升级所带来的投资机会，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定增值。
投资策略	本基金在大类资产配置过程中，在严格控制投资组合风险的前提下，将优先考虑对于股票类资产的配置，在采取精选策略构造股票组合的基础上，将剩余资产配置于债券、权证、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种。
业绩比较基准	50%*申银万国制造业指数+50%*中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	(010) 67595096
传真		(010) 58163027	(010) 66275853
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号	北京市西城区闹市口大街 1 号

	东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码	100738	100033
法定代表人	王珠林	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）北京分所	北京市东城区东长安街 1 号东方经贸城德勤大楼 2 层、7 层、8 层、9 层、15 层 1-3 室
注册登记机构	银华基金管理有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	165,897,389.85	-8,601,437.59
本期利润	186,405,542.12	-22,233,856.73
加权平均基金份额本期利润	0.2171	-0.0097
本期加权平均净值利润率	18.20%	-0.97%
本期基金份额净值增长率	14.14%	-1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	12,445,191.86	-22,233,856.73
期末可供分配基金份额利润	0.0258	-0.0097
期末基金资产净值	544,225,399.99	2,265,024,808.18
期末基金份额净值	1.130	0.990
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	13.00%	-1.00%

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

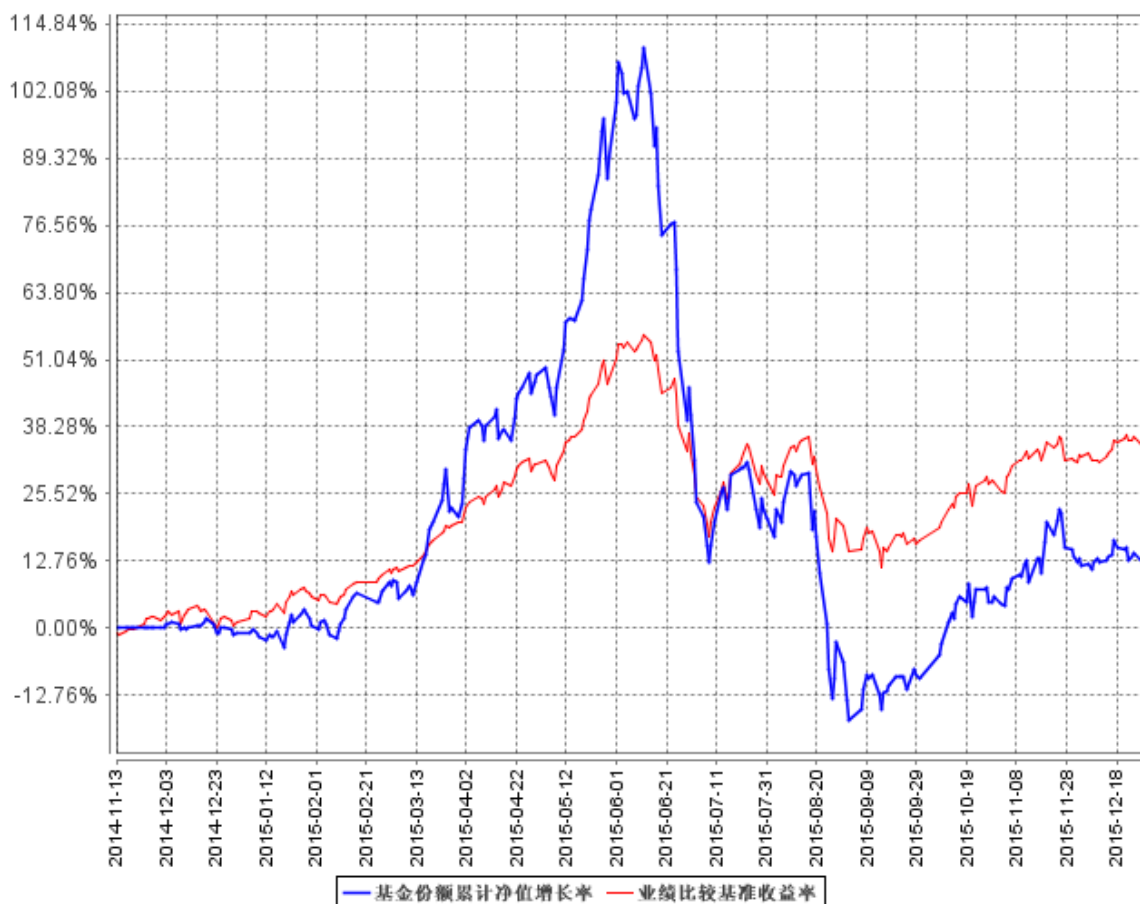
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	24.86%	2.21%	16.29%	1.08%	8.57%	1.13%
过去六个月	-22.50%	3.14%	-0.99%	1.67%	-21.51%	1.47%
过去一年	14.14%	2.92%	34.18%	1.44%	-20.04%	1.48%
自基金合同生效起至今	13.00%	2.74%	35.60%	1.38%	-22.60%	1.36%

注：本基金业绩比较基准：50%*申银万国制造业指数+50%*中证全债指数。本基金股票部分主要投资于高端制造行业股票。申银万国制造业指数对制造行业股票具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。固定收益部分的业绩比较基准则采用能够较好的反映债券市场变动全貌的中证全债指数。

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

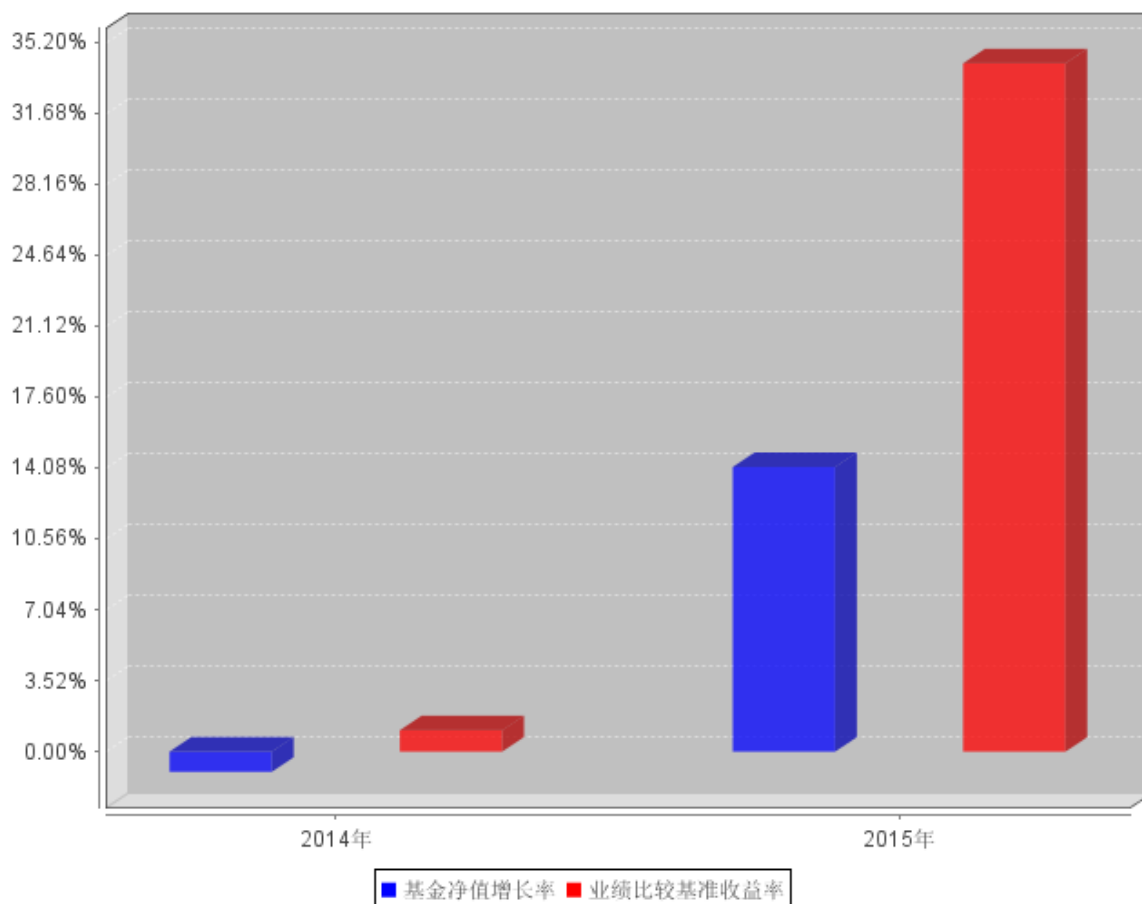
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于股指期货、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）等金融工具，其中投资于本基金界定的高端制造业行业范围内股票和债券不低于非现金资产的 80%；基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金或投资于在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2015 年度、2014 年 11 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人管理着 55 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、银华永泰积极债券型证券投资基金、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、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及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、银华中证国防安全指数分级证券投资基金、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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。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		
彭颖颖女士	本基金的基金经理	2014年11月13日	-	5年	硕士研究生学历。2007年至2008年任职于Ernst & Young波士顿资产管理部门从事审计工作。2009年至今，任职于银华基金管理有限公司研究部。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、《银华高端制造业灵活配置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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理有限公司公平交易制度》，对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等，规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程，完善公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理有限公司公平交易制度》，制定了《银华基金管理有限公司公平交易执行制度》，规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制；明确了交易执行环节的集中交易制度，并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外，为了加强对异常交易行为的日常监控，本基金管理人还制定了《银华基金管理有限公司异常交易监控实施细则》，规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备

流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人又对上述制度进行了修改完善，进一步修订了公平交易的范围，修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点，并强调了本基金管理人内部控制的要求，具体控制方法为：1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现，不掺杂任何的人为判断，所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行，公平交易程序自动启动；2、一般情况下，场外交易指令以组合的名义下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

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，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。

在投资决策环节，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。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 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 2 次，这两次反向交易属于指数基金或量化专户与其他基金的同日反向交易，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

2015 年在 A 股历史上是波动剧烈的一年，由于此次暴跌叠加了巨大的杠杆资金，市场下跌的速度之快也是前所未有的，只有在市场暴跌的初期有机会可以将仓位降下来的，暴跌中后期演变成了无量暴跌，如果在初期没有将仓位减下来就基本上错失了减仓的机会，本基金在市场的暴跌中由于减仓操作不够及时导致基金净值回撤较大，在未来的基金操作中将对基金风险的控制。

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 1.130 元，本报告期份额净值增长率为 14.14%，同期业绩比较基准收益率为 34.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响 2016 年 A 股市场走势的重大变量包括人民币汇率的大幅贬值以及国内流动性的变化，以及股票注册制的实施速度。

元旦过后，在岸和离岸人民币均创出了汇改以来的最大贬值幅度，并且 2015 年 12 月的外汇储备下降 1079 亿美元，创了历史上最大的单月降幅，资本外流规模加大了外汇储备的下行压力。在目前中国经济下行压力较大的整体环境下人民币的加速贬值短期将会影响市场的风险偏好，A 股市场也随之出现了恐慌性的情绪。但是人民币汇率的快调可以一定程度上缓解渐进式贬值预期强化导致的资本流出的恶性循环，人民币汇率是否能在贬值过程中寻找到均衡点是最需要观察的。虽然市场预期将会有降准降息对冲资本的加速外流，但是 2016 年国内流动性相较于 2015 年肯定是趋紧的，这也就决定了 A 股市场的整体资金面将不如 2015 年宽松，加上 2015 年 A 股市场的两次暴跌去杠杆效果比较显著，2016 年杠杆资金对于股市上行的影响也会偏弱。

目前市场预期注册制将在 2016 年落地实施,虽然中国的注册制仍将是控制发行节奏的发行体系,但是注册制从长远来看将逐渐改变 A 股壳资源的极度稀缺性,A 股过去十年最有效并且可以获得最大超额收益的最小市值公司投资策略将会逐渐失效,对于垃圾股票的鉴别能力需要加强,创业板的整体表现会受到一定程度的冲击,但是未来 A 股最大的投资机会仍来源于创新型公司,优秀公司和垃圾公司的表现会有较大分化。

以创业板为代表的成长股已经走出了 2013-2015 的三年牛市,2016 年 A 股市场整体大概率是宽幅震荡市,大幅波动对于基金经理在蓝筹和成长的风格切换以及仓位大幅变动这两个关键问题上将形成重大考验。

2015 年四季度 A 股市场经历了第三季度的暴跌后展开了一波超跌反弹行情,四季度不同板块及个股之间的表现分化十分严重,截止四季度末以计算机为代表的强势指数已经反弹到 7 月救市后的最高点位,并且很多强势个股已经创出了历史新高。截止四季度末,沪深 300 平均 TTM 市盈率水平为 14 倍 PE,已经接近近五年沪深 300 的最高水位;而创业板的平均 TTM 市盈率水平为 96 倍 PE,创业板的平均市盈率水平快速反弹回到了 4 月份的水平,从 A 股市场整体的估值水平来看还是处于相当高的水位。本基金的行业属性决定了本基金在 2016 年还将以成长股为重点配置对象,由于 2015 年 12 月份创业板基本上没有调整,估值和市值都整体处于较高水位,价值投资者感觉到无从下手,快速调整后也能让偏好成长股的投资者更好地甄选股票和板块,并且也给 2016 年整体留出了相对更大的空间。本基金在 2016 年重点关注的板块包括军工、智能物流设备、汽车电子及汽车后市场以及核电设备几个板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制,根据不同基金的特点与发展情况,及时界定新的风险点,评价风险级别,并纳入稽核计划。首先,本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础,对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查,并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果,部门总监签字确认后,将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时,还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节,持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查,并对基金的投资比例进行日常监控,对关联交易的日常维护,对基金持仓流动性风险定期关注,并对公平交易执行情况进行检查等等;在营销与销售方面,本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查;在基金的运作保障方面,本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金

估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师京报(审)字(16)第 P0503 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
引言段	我们审计了后附的银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度及 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人银华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错

	<p>报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度及 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	吕静 刘欣
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	34,465,669.07	1,395,352,463.70
结算备付金		10,868,276.16	3,282,306.45
存出保证金		1,640,905.40	74,526.84
交易性金融资产	7.4.7.2	505,068,379.87	951,083,780.84
其中：股票投资		505,068,379.87	951,083,780.84
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	13,951.93	344,077.15
应收股利		-	-
应收申购款		824,221.72	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		552,881,404.15	2,350,137,154.98
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	78,030,235.10
应付赎回款		2,064,930.92	-
应付管理人报酬		710,158.20	2,924,308.20
应付托管费		118,359.72	487,384.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,378,186.52	3,670,418.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	384,368.80	-
负债合计		8,656,004.16	85,112,346.80
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	481,695,423.34	2,287,258,664.91
未分配利润	7.4.7.10	62,529,976.65	-22,233,856.73
所有者权益合计		544,225,399.99	2,265,024,808.18
负债和所有者权益总计		552,881,404.15	2,350,137,154.98

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.130 元，基金份额总额为 481,695,423.34 份。

2. 上年度会计期间为 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		249,764,399.82	-11,287,527.59
1. 利息收入		1,686,875.44	1,916,172.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,672,578.26	1,887,082.26
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		14,297.18	29,090.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		211,764,764.52	382,903.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	209,025,304.75	382,903.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,739,459.77	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	20,508,152.27	-13,632,419.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,804,607.59	45,816.08
减：二、费用		63,358,857.70	10,946,329.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,589,129.84	4,522,434.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,598,188.26	753,739.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	44,732,316.46	5,667,228.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	439,223.14	2,927.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		186,405,542.12	-22,233,856.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		186,405,542.12	-22,233,856.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

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（基金净值）	2,287,258,664.91	-22,233,856.73	2,265,024,808.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	186,405,542.12	186,405,542.12
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）	-1,805,563,241.57	-101,641,708.74	-1,907,204,950.31
其中：1. 基金申购款	1,323,094,957.20	781,452,625.53	2,104,547,582.73
2. 基金赎回款	-3,128,658,198.77	-883,094,334.27	-4,011,752,533.04
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）	481,695,423.34	62,529,976.65	544,225,399.99
项目	上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)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（基金净值）	2,287,258,664.91	-	2,287,258,664.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,233,856.73	-22,233,856.73
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	2,287,258,664.91	-22,233,856.73	2,265,024,808.18

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>杨清</u>	<u>龚飒</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2014]813 号文批准公开发行。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 2,287,258,664.91 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 13 日正式生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及公告的《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包含国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、权证、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括定期存款和协议存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准:50%×申银万国制造业指数+50%×中证全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则以及 2014 年颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的

若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度及 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。可比期间的会计年度为 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)起至 2014 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：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两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第 1 层次：输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第 2 层次：输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第 3 层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

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首次取得成本时，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首次取得成本时，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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；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；

(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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全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价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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利得/(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“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 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预计收益率计算的金额，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)，在实际持有期间内逐日计提；

(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，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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。

7.4.4.10 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)在实际持有期间内逐日计提；

(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。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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式为现金分红。投资者可事先选择将所获分配的现金收益按除息日份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 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〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定,自 2015 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。2015 年 3 月 25 日,相关调整对本基金前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.5%。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税;
- (2) 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,暂不缴纳企业所得税;
- (3) 对基金所持上市公司股票,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,其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,2015 年 9 月 8 日之前其股息红利所得暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；

(6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	34,465,669.07	1,395,352,463.70
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	34,465,669.07	1,395,352,463.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	498,192,646.74	505,068,379.87	6,875,733.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	498,192,646.74	505,068,379.87	6,875,733.13
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	964,716,199.98	951,083,780.84	-13,632,419.14

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	964,716,199.98	951,083,780.84	-13,632,419.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	7,702.78	342,415.49
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,379.77	1,624.81
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	57.14	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	812.24	36.85
合计	13,951.93	344,077.15

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,378,186.52	3,670,418.82
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	5,378,186.52	3,670,418.82
----	--------------	--------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,368.80	-
预提费用	380,000.00	-
合计	384,368.80	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,287,258,664.91	2,287,258,664.91
本期申购	1,323,094,957.20	1,323,094,957.20
本期赎回（以“-”号填列）	-3,128,658,198.77	-3,128,658,198.77
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	481,695,423.34	481,695,423.34

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,601,437.59	-13,632,419.14	-22,233,856.73
本期利润	165,897,389.85	20,508,152.27	186,405,542.12
本期基金份额交易产生的变动数	-144,850,760.40	43,209,051.66	-101,641,708.74
其中：基金申购款	547,243,960.16	234,208,665.37	781,452,625.53
基金赎回款	-692,094,720.56	-190,999,613.71	-883,094,334.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,445,191.86	50,084,784.79	62,529,976.65

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	1,434,103.43	1,882,550.51
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	209,697.97	4,431.18
其他	28,776.86	100.57
合计	1,672,578.26	1,887,082.26

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金 合同生效日)至2014年12月 31日
卖出股票成交总额	14,914,669,964.92	1,533,681,908.28
减：卖出股票成本总额	14,705,644,660.17	1,533,299,005.14
买卖股票差价收入	209,025,304.75	382,903.14

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2014年11月13日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
权证投资收益	-	-

股指期货-投资收益	-	-
-----------	---	---

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,739,459.77	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,739,459.77	-

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	20,508,152.27	-13,632,419.14
——股票投资	20,508,152.27	-13,632,419.14
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	20,508,152.27	-13,632,419.14

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	15,304,688.33	-
转换费收入	499,919.26	-
其他	-	45,816.08
合计	15,804,607.59	45,816.08

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	44,732,316.46	5,667,228.35
银行间市场交易费用	-	-
合计	44,732,316.46	5,667,228.35

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	300,000.00	-
债券账户维护费	25,950.00	-
银行费用	33,273.14	2,927.06
合计	439,223.14	2,927.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
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
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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
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
银华财富资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年 12月31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	1,362,706,211.02	4.67%	638,448,515.04	15.84%
西南证券	604,837,555.57	2.07%	-	-
第一创业	310,398,347.24	1.06%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 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。

7.4.10.1.5 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12月31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	1,245,631.35	4.66%	223,968.90	4.16%
西南证券	552,086.42	2.07%	64,420.23	1.20%
第一创业	289,075.68	1.08%	272,835.47	5.07%

关联方名称	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年12月31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	581,243.95	15.84%	581,243.95	15.84%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付 的管理费	15,589,129.84
其中：支付销售机构的客 户维护费	9,303,581.56	2,975,858.17

注：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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年11月13日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付 的托管费	2,598,188.26

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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本报告期以及上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
西南证 券	-	-	19,999,550.00	0.87%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 11 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	34,465,669.07	1,434,103.43	1,395,352,463.70	1,882,550.51

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
002434	万里扬	2015 年 11 月 25 日	重大事项	23.05	-	-	796,317	14,949,438.87	18,355,106.85	-

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层

和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券可在银行间同业市场交易，其余在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	34,465,669.07	-	-	-	-	-	34,465,669.07
结算备付金	10,868,276.16	-	-	-	-	-	10,868,276.16
存出保证金	1,640,905.40	-	-	-	-	-	1,640,905.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	505,068,379.87	505,068,379.87
应收利息	-	-	-	-	-	13,951.93	13,951.93
应收申购款	-	-	-	-	-	824,221.72	824,221.72
资产总计	46,974,850.63	-	-	-	-	505,906,553.52	552,881,404.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,064,930.92	2,064,930.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	710,158.20	710,158.20
应付托管费	-	-	-	-	-	118,359.72	118,359.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,378,186.52	5,378,186.52
其他负债	-	-	-	-	-	384,368.80	384,368.80
负债总计	-	-	-	-	-	8,656,004.16	8,656,004.16
利率敏感度缺口	46,974,850.63	-	-	-	-	-497,250,549.36	544,225,399.99
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,395,352,463.70	-	-	-	-	-	1,395,352,463.70
结算备付金	3,282,306.45	-	-	-	-	-	3,282,306.45
存出保证金	74,526.84	-	-	-	-	-	74,526.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	951,083,780.84	951,083,780.84
应收利息	-	-	-	-	-	344,077.15	344,077.15
资产总计	1,398,709,296.99	-	-	-	-	-951,427,857.99	2,350,137,154.98
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	78,030,235.10	78,030,235.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,924,308.20	2,924,308.20

应付托管费	-	-	-	-	487,384.68	487,384.68
应付交易费用	-	-	-	-	3,670,418.82	3,670,418.82
负债总计	-	-	-	-	85,112,346.80	85,112,346.80
利率敏感度缺口	1,398,709,296.99	-	-	-	-866,315,511.19	2,265,024,808.18

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在 2015 年末及 2014 年末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	505,068,379.87	92.80	951,083,780.84	41.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	505,068,379.87	92.80	951,083,780.84	41.99

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+5%	96,616,239.43	45,694,906.57
	-5%	-96,616,239.43	-45,694,906.57

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持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 486,713,273.02 元，属于第二层次的余额为 18,355,106.85 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 951,083,780.84 元，无属于第二层次、第三层次的余额)。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。如附注 7.4.5.2 所述，本基金自 2015 年 3 月 25 日起，对所持有的在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)的估值方法进行调整，采

用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

(3) 本财务报表已于 2016 年 3 月 23 日经本基金管理人批准报出。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	505,068,379.87	91.35
	其中：股票	505,068,379.87	91.35
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	-	-
	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	45,333,945.23	8.20
7	其他各项资产	2,479,079.05	0.45
8	合计	552,881,404.15	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	344,242,493.49	63.25
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	130,137,820.88	23.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,505,984.00	2.67
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	16,182,081.50	2.97
S	综合	-	-
	合计	505,068,379.87	92.80

8.2.2 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股票投资。

8.3 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

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	300050	世纪鼎利	946,045	33,963,015.50	6.24
2	300075	数字政通	905,200	28,378,020.00	5.21
3	300212	易华录	594,614	27,453,328.38	5.04
4	300230	永利股份	651,644	24,351,936.28	4.47
5	603308	应流股份	735,500	23,035,860.00	4.23

6	000700	模塑科技	909,930	22,084,001.10	4.06
7	300128	锦富新材	869,549	22,034,371.66	4.05
8	002456	欧菲光	707,750	21,954,405.00	4.03
9	002366	台海核电	325,621	21,474,704.95	3.95
10	002609	捷顺科技	983,700	20,519,982.00	3.77
11	300486	东杰智能	400,797	19,983,738.42	3.67
12	002373	千方科技	433,300	19,823,475.00	3.64
13	300250	初灵信息	248,428	19,772,384.52	3.63
14	002592	八菱科技	440,554	19,472,486.80	3.58
15	002444	巨星科技	938,485	19,426,639.50	3.57
16	002345	潮宏基	1,103,312	18,623,906.56	3.42
17	002434	万里扬	796,317	18,355,106.85	3.37
18	300100	双林股份	561,573	17,588,466.36	3.23
19	600667	太极实业	1,555,559	17,344,482.85	3.19
20	300420	五洋科技	280,950	17,343,043.50	3.19
21	002256	彩虹精化	607,773	16,245,772.29	2.99
22	000607	华媒控股	1,143,610	16,182,081.50	2.97
23	300314	戴维医疗	475,323	16,175,241.69	2.97
24	600340	华夏幸福	472,200	14,505,984.00	2.67
25	002026	山东威达	509,418	8,975,945.16	1.65

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600060	海信电器	244,371,674.98	10.79
2	300212	易华录	243,787,047.94	10.76
3	002256	彩虹精化	234,828,579.73	10.37
4	600143	金发科技	227,189,445.85	10.03
5	000768	中航飞机	209,603,799.34	9.25
6	300318	博晖创新	192,095,627.17	8.48
7	601989	中国重工	180,989,858.35	7.99
8	600582	天地科技	162,336,772.67	7.17
9	600583	海油工程	147,867,248.23	6.53
10	000039	中集集团	145,942,253.14	6.44

11	300050	世纪鼎利	143,505,545.22	6.34
12	000826	启迪桑德	130,842,311.20	5.78
13	002228	合兴包装	124,833,908.54	5.51
14	600118	中国卫星	121,372,230.64	5.36
15	000625	长安汽车	121,002,360.66	5.34
16	601608	中信重工	113,943,327.19	5.03
17	002353	杰瑞股份	113,633,603.48	5.02
18	601766	中国中车	113,526,640.59	5.01
19	002366	台海核电	107,605,573.48	4.75
20	600592	龙溪股份	106,846,167.94	4.72
21	300292	吴通控股	105,753,424.89	4.67
22	601799	星宇股份	105,394,934.27	4.65
23	300024	机器人	105,351,008.84	4.65
24	300314	戴维医疗	104,732,248.73	4.62
25	600016	民生银行	103,732,103.58	4.58
26	300098	高新兴	103,424,239.38	4.57
27	601166	兴业银行	102,745,118.21	4.54
28	300090	盛运环保	102,050,365.46	4.51
29	002508	老板电器	100,425,717.60	4.43
30	600050	中国联通	99,969,432.04	4.41
31	002073	软控股份	99,836,480.74	4.41
32	300128	锦富新材	98,893,316.95	4.37
33	002518	科士达	98,669,456.48	4.36
34	601727	上海电气	97,454,881.48	4.30
35	002715	登云股份	96,765,276.16	4.27
36	000816	智慧农业	96,511,219.55	4.26
37	300431	暴风科技	96,350,267.01	4.25
38	300250	初灵信息	96,111,978.10	4.24
39	603019	中科曙光	88,310,652.60	3.90
40	300166	东方国信	85,671,057.01	3.78
41	000049	德赛电池	85,352,867.39	3.77
42	002690	美亚光电	85,287,982.65	3.77
43	002456	欧菲光	84,282,688.31	3.72
44	000700	模塑科技	83,395,819.93	3.68
45	002202	金风科技	83,062,496.12	3.67
46	600031	三一重工	81,111,472.61	3.58

47	300154	瑞凌股份	79,862,260.96	3.53
48	300012	华测检测	79,836,519.70	3.52
49	002184	海得控制	77,263,086.06	3.41
50	300171	东富龙	76,946,404.14	3.40
51	300263	隆华节能	76,204,954.42	3.36
52	000157	中联重科	75,896,525.05	3.35
53	600028	中国石化	74,882,865.60	3.31
54	600104	上汽集团	74,256,768.69	3.28
55	002339	积成电子	71,882,956.07	3.17
56	300120	经纬电材	70,126,353.12	3.10
57	002241	歌尔声学	70,009,665.89	3.09
58	300228	富瑞特装	69,016,630.09	3.05
59	002657	中科金财	67,891,117.32	3.00
60	000725	京东方A	67,581,911.09	2.98
61	600089	特变电工	67,023,705.96	2.96
62	002611	东方精工	66,706,215.54	2.95
63	300115	长盈精密	66,521,562.52	2.94
64	000550	江铃汽车	66,510,383.92	2.94
65	002475	立讯精密	65,259,261.55	2.88
66	002074	国轩高科	64,738,606.07	2.86
67	600270	外运发展	63,948,076.35	2.82
68	000821	京山轻机	63,922,169.60	2.82
69	601985	中国核电	63,903,629.55	2.82
70	600038	中直股份	63,629,688.13	2.81
71	601318	中国平安	63,248,727.76	2.79
72	600584	长电科技	62,967,933.31	2.78
73	000001	平安银行	62,907,438.00	2.78
74	002358	森源电气	62,802,621.79	2.77
75	002544	杰赛科技	62,738,046.08	2.77
76	002363	隆基机械	62,254,945.84	2.75
77	601038	一拖股份	61,195,320.51	2.70
78	600008	首创股份	58,548,818.71	2.58
79	002412	汉森制药	57,732,115.05	2.55
80	600522	中天科技	57,001,205.30	2.52
81	002658	雪迪龙	56,959,461.25	2.51
82	002407	多氟多	56,171,791.72	2.48

83	600875	东方电气	55,493,027.57	2.45
84	600316	洪都航空	54,384,601.78	2.40
85	002415	海康威视	54,365,792.00	2.40
86	601628	中国人寿	52,904,275.39	2.34
87	600240	华业资本	52,880,880.86	2.33
88	300037	新宙邦	52,513,908.24	2.32
89	600770	综艺股份	52,319,919.30	2.31
90	000651	格力电器	52,270,888.34	2.31
91	601800	中国交建	51,656,261.74	2.28
92	000425	徐工机械	50,938,291.79	2.25
93	300248	新开普	50,050,548.93	2.21
94	002253	川大智胜	50,027,720.05	2.21
95	002519	银河电子	49,148,733.57	2.17
96	002450	康得新	48,676,998.50	2.15
97	600517	置信电气	47,348,847.14	2.09
98	300001	特锐德	47,267,228.84	2.09
99	002129	中环股份	47,140,752.85	2.08
100	000928	中钢国际	46,578,943.55	2.06
101	300010	立思辰	46,024,871.23	2.03
102	300104	乐视网	45,954,448.00	2.03
103	600027	华电国际	45,947,915.06	2.03

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。

8.4.2 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	600143	金发科技	255,958,362.10	11.30
2	600060	海信电器	247,538,353.44	10.93
3	000768	中航飞机	229,059,287.85	10.11
4	300212	易华录	226,030,539.69	9.98
5	002256	彩虹精化	205,357,370.00	9.07
6	300318	博晖创新	204,364,787.32	9.02
7	300024	机器人	171,104,986.82	7.55
8	601989	中国重工	164,852,710.93	7.28
9	600582	天地科技	150,291,907.51	6.64
10	002366	台海核电	148,185,759.56	6.54

11	600031	三一重工	144,125,965.42	6.36
12	000039	中集集团	133,987,379.22	5.92
13	600583	海油工程	130,996,905.94	5.78
14	000826	启迪桑德	126,916,950.84	5.60
15	000157	中联重科	125,529,918.53	5.54
16	000625	长安汽车	122,900,157.72	5.43
17	002228	合兴包装	119,418,245.20	5.27
18	600118	中国卫星	117,513,846.83	5.19
19	300263	隆华节能	115,992,008.74	5.12
20	300050	世纪鼎利	115,373,738.98	5.09
21	601766	中国中车	113,770,853.07	5.02
22	601608	中信重工	113,635,952.76	5.02
23	002353	杰瑞股份	112,600,292.90	4.97
24	300090	盛运环保	110,897,602.93	4.90
25	600875	东方电气	110,290,330.05	4.87
26	300292	吴通控股	107,978,884.66	4.77
27	601038	一拖股份	106,286,686.91	4.69
28	000425	徐工机械	105,996,949.24	4.68
29	002508	老板电器	105,892,133.60	4.68
30	300098	高新兴	104,600,194.01	4.62
31	000816	智慧农业	103,920,563.96	4.59
32	600016	民生银行	102,601,910.90	4.53
33	601166	兴业银行	101,946,530.40	4.50
34	002184	海得控制	100,335,054.36	4.43
35	300250	初灵信息	99,321,435.79	4.39
36	600050	中国联通	98,660,345.98	4.36
37	002715	登云股份	96,415,684.22	4.26
38	600522	中天科技	95,708,917.87	4.23
39	002074	国轩高科	95,379,730.57	4.21
40	002690	美亚光电	95,083,935.37	4.20
41	601799	星宇股份	94,943,226.88	4.19
42	002073	软控股份	94,813,470.10	4.19
43	000049	德赛电池	94,781,414.39	4.18
44	601186	中国铁建	93,826,935.10	4.14
45	601727	上海电气	90,986,258.79	4.02
46	600158	中体产业	90,657,680.40	4.00
47	300012	华测检测	88,899,612.33	3.92
48	002518	科士达	88,065,893.21	3.89

49	300431	暴风科技	87,983,609.93	3.88
50	601390	中国中铁	85,725,799.54	3.78
51	000821	京山轻机	84,947,087.71	3.75
52	000100	TCL 集团	84,826,169.24	3.75
53	300171	东富龙	84,027,466.69	3.71
54	002202	金风科技	83,117,874.11	3.67
55	600592	龙溪股份	82,168,765.44	3.63
56	300128	锦富新材	81,693,541.72	3.61
57	300248	新开普	81,299,061.99	3.59
58	000700	模塑科技	77,574,075.24	3.42
59	002657	中科金财	76,882,068.74	3.39
60	002339	积成电子	76,473,815.44	3.38
61	600028	中国石化	75,634,942.98	3.34
62	002475	立讯精密	72,826,326.46	3.22
63	300010	立思辰	72,272,558.62	3.19
64	600104	上汽集团	72,052,026.42	3.18
65	603019	中科曙光	71,797,348.20	3.17
66	600038	中直股份	70,959,373.15	3.13
67	300154	瑞凌股份	69,333,683.82	3.06
68	002407	多氟多	69,201,685.78	3.06
69	000725	京东方 A	68,982,397.03	3.05
70	002241	歌尔声学	68,334,791.70	3.02
71	002658	雪迪龙	67,619,457.37	2.99
72	300314	戴维医疗	67,198,828.99	2.97
73	000550	江铃汽车	66,981,860.99	2.96
74	600270	外运发展	66,434,183.46	2.93
75	002611	东方精工	66,429,931.23	2.93
76	600089	特变电工	66,170,220.29	2.92
77	600584	长电科技	65,314,084.25	2.88
78	601318	中国平安	65,166,080.59	2.88
79	300228	富瑞特装	64,936,251.97	2.87
80	600055	华润万东	64,663,274.42	2.85
81	002363	隆基机械	64,628,865.35	2.85
82	300166	东方国信	64,271,782.74	2.84
83	300037	新宙邦	63,529,278.77	2.80
84	300115	长盈精密	63,199,444.37	2.79
85	002358	森源电气	62,858,314.05	2.78
86	000001	平安银行	60,625,504.60	2.68

87	601179	中国西电	59,989,395.72	2.65
88	600240	华业资本	59,894,861.10	2.64
89	600770	综艺股份	59,838,027.31	2.64
90	600418	江淮汽车	59,825,678.22	2.64
91	002544	杰赛科技	59,155,274.61	2.61
92	600008	首创股份	57,600,056.30	2.54
93	300278	华昌达	57,360,658.80	2.53
94	002415	海康威视	56,474,837.99	2.49
95	000901	航天科技	55,943,681.36	2.47
96	002450	康得新	55,913,954.49	2.47
97	000651	格力电器	55,608,373.90	2.46
98	601628	中国人寿	53,678,115.82	2.37
99	601985	中国核电	53,496,143.20	2.36
100	600316	洪都航空	52,629,679.91	2.32
101	002456	欧菲光	52,333,815.73	2.31
102	002229	鸿博股份	51,871,329.08	2.29
103	002253	川大智胜	51,574,223.71	2.28
104	002129	中环股份	51,499,118.56	2.27
105	300170	汉得信息	49,700,040.21	2.19
106	601800	中国交建	48,496,686.12	2.14
107	002519	银河电子	48,390,676.93	2.14
108	300104	乐视网	47,997,354.71	2.12
109	002282	博深工具	47,539,755.89	2.10
110	002412	汉森制药	47,290,338.36	2.09
111	300004	南风股份	45,667,471.53	2.02
112	300001	特锐德	45,330,253.68	2.00

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。

8.4.3 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	14,239,121,106.93
卖出股票收入（成交）总额	14,914,669,964.92

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,640,905.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,951.93
5	应收申购款	824,221.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,479,079.05

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 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
25,281	19,053.65	526,896.94	0.11%	481,168,526.40	99.89%

9.2 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	111,350.23	0.02%

9.3 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

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年11月13日）基金份额总额	2,287,258,664.91
本报告期期初基金份额总额	2,287,258,664.91
本报告期基金总申购份额	1,323,094,957.20

减:本报告期基金总赎回份额	3,128,658,198.77
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	481,695,423.34

注:本期申购中含转换入份额,本期赎回中含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

11.2.1 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。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 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德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所,报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 80,000.00 元。目前的审计机构系第一次为本基金提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华创证券有限责任公司	2	22,734,053,368.98	9.38%	2,503,840.68	9.38%	-
国金证券股份有限公司	2	22,498,447,603.43	8.57%	2,290,683.02	8.58%	-
东方证券股份有限公司	2	22,348,968,605.21	8.06%	2,180,516.31	8.17%	-
东兴证券股份有限公司	2	1,974,921,552.68	6.77%	1,798,863.93	6.74%	-
申万宏源集团股份有限公司	3	1,760,072,733.34	6.04%	1,602,818.58	6.00%	-
华泰证券股份有限公司	5	1,428,152,373.54	4.90%	1,300,192.58	4.87%	新增 2 个交易单元
方正证券股份有限公司	5	1,414,488,538.16	4.85%	1,317,313.14	4.93%	新增 4 个交易单元
东北证券股份有限公司	3	1,362,706,211.02	4.67%	1,245,631.35	4.66%	-
中国国际金融有限公司	2	1,226,928,444.40	4.21%	1,116,993.00	4.18%	-
平安证券有限责任公司	1	1,082,372,533.05	3.71%	985,391.82	3.69%	-
海通证券股份有限公司	2	907,323,406.28	3.11%	826,028.60	3.09%	-
兴业证券股份有限公司	3	863,230,216.73	2.96%	785,882.83	2.94%	-
中银国际证券有限责任公司	2	803,459,335.92	2.76%	731,468.34	2.74%	-
中信建投证券股份有限公司	1	801,329,357.43	2.75%	737,229.47	2.76%	-
安信证券股份有限公司	3	699,281,009.69	2.40%	643,137.66	2.41%	-

中信证券股份 有限公司	3	674,175,894.74	2.31%	613,771.11	2.30%	-
长江证券股份 有限公司	2	620,470,831.28	2.13%	566,343.62	2.12%	-
湘财证券股份 有限公司	1	617,079,224.79	2.12%	561,790.34	2.10%	-
西南证券股份 有限公司	1	604,837,555.57	2.07%	552,086.42	2.07%	-
广发证券股份 有限公司	2	599,031,409.11	2.05%	545,358.32	2.04%	-
国信证券股份 有限公司	3	487,234,971.39	1.67%	443,578.32	1.66%	-
新时代证券股 份有限公司	2	368,221,419.26	1.26%	338,434.78	1.27%	新增 1 个交 易单元
光大证券股份 有限公司	3	320,199,046.13	1.10%	295,377.81	1.11%	-
第一创业证券 股份有限公司	2	310,398,347.24	1.06%	289,075.68	1.08%	-
中国银河证券 股份有限公司	1	285,086,169.97	0.98%	260,802.77	0.98%	-
上海华信证券 有限责任公司	1	282,679,622.62	0.97%	257,352.32	0.96%	-
华安证券股份 有限公司	1	272,593,011.66	0.94%	248,168.41	0.93%	-
华宝证券有限 责任公司	1	270,441,394.94	0.93%	251,861.59	0.94%	-
民生证券股份 有限公司	2	258,299,737.69	0.89%	240,554.32	0.90%	-
北京高华证券 有限责任公司	1	178,812,335.32	0.61%	162,789.76	0.61%	-
中泰证券股份 有限公司	1	175,763,105.71	0.60%	160,010.64	0.60%	-
太平洋证券股 份有限公司	2	152,484,245.56	0.52%	142,008.44	0.53%	-
红塔证券股份 有限公司	1	141,142,168.23	0.48%	131,443.22	0.49%	-
开源证券股份 有限公司	1	130,588,036.83	0.45%	121,616.07	0.46%	新增 1 个交 易单元
渤海证券股份 有限公司	1	109,554,254.57	0.38%	102,026.75	0.38%	-
长城证券股份 有限公司	3	94,106,346.31	0.32%	85,674.54	0.32%	-
上海证券有限	1	87,066,640.56	0.30%	79,264.79	0.30%	-

责任公司							
广州证券股份 有限公司	1	85,267,456.03	0.29%	77,627.61	0.29%	-	
中国中投证券 有限责任公司	1	68,784,986.32	0.24%	62,622.43	0.23%	-	
日信证券有限 责任公司	1	39,691,271.96	0.14%	36,133.69	0.14%	-	
招商证券股份 有限公司	2	14,016,353.20	0.05%	13,053.79	0.05%	-	
江海证券有限 公司	2	-	-	-	-	-	
国都证券有股 份有限公司	2	-	-	-	-	-	
首创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-	
东莞证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
西部证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
中信证券（山 东）有限责任公 司	1	-	-	-	-	-	
中原证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-	
东吴证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-	新增 2 个交 易单元
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-	
德邦证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	
华融证券股份 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理有限公司 2014 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 1 月 8 日
3	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 1 月 8 日
4	《关于增加兴业证券为银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 1 月 9 日
5	《银华基金管理有限公司关于银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 1 月 10 日
6	《银华基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 2 月 14 日
7	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通转换业务的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 3 月 5 日
8	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易业务的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 3 月 6 日

9	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 11 日
10	《关于旗下部分基金持有的长安汽车、高新兴、中天科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
11	《银华基金管理有限公司关于银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金在交通银行开通转换、定期定额投资业务并参加交通银行费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
12	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的光明乳业、盛运股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
13	《银华基金管理有限公司关于增加太平洋证券为旗下部分基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 25 日
14	《银华基金管理有限公司关于增加中金公司为旗下部分基金代销及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
15	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华昌达估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 4 日
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中环股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 18 日
17	《银华高端制造业灵活配置混合	三大证券报及本基	2015 年 4 月 22 日

	型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》	金管理人网站	
18	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东方航空、久联发展、模塑科技、博晖创新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 24 日
19	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
20	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的神舟高铁、开山股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 9 日
21	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中国北车、中国南车、方大炭素、华润万东估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 21 日
22	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金螳螂、正泰电器、亿帆鑫富、国睿科技、多氟多、深科技、高德红外、长信科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 23 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富(北京)信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
24	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报及本基	2015 年 6 月 18 日

	下部分基金持有的京天利、暴风科技、中国重工估值方法调整的公告》	金管理人网站	
26	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 26 日
27	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 27 日
28	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 27 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的新界泵业、哈空调、通源石油、兴源环境、骆驼股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 27 日
30	《关于旗下部分基金持有的中环股份、宗申动力、沱牌舍得、河北钢铁、新兴铸管、海亮股份、信质电机、长江电力、戴维医疗估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 7 月 4 日
31	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的易华录、广陆数测估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 7 月 8 日
32	《关于旗下部分基金持有的荣之联、银之杰、德尔家居、开山股份、隆华节能、彩虹精化、雏鹰农牧、阳光电源、隆鑫通用、合	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 7 月 9 日

	兴包装、得润电子、长信科技估值方法调整的公告》		
33	《银华基金管理有限公司关于增加广东顺德农商行为银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 9 日
34	《关于旗下部分基金持有的海康威视、亿帆鑫富、东华软件、光明乳业、农发种业、综艺股份、永泰能源、丹甫股份、老板电器、海利得估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 11 日
35	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 20 日
36	《银华基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 27 日
37	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 31 日
38	《银华基金管理有限公司关于增加中信期货为旗下部分基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 7 月 31 日
39	《关于旗下部分基金持有的彩虹精化估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 8 月 8 日
40	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中金公司费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 8 月 21 日
41	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报、证券日	2015 年 8 月 24 日

	下基金停止在中信证券（浙江）所有代销业务的公告》	报及本基金管理人网站	
42	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 8 月 26 日
43	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 8 月 26 日
44	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 8 月 26 日
45	《关于旗下部分基金持有的鼎汉技术、吉林森工、凯瑞德、广晟有色、盛和资源、国投电力、恒立油缸估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 8 月 27 日
46	《关于旗下部分基金持有的黄河旋风估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 8 月 29 日
47	《关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金代销等业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 9 月 15 日
48	《关于增加北京微动利投资管理有限公司为旗下部分基金代销等业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 9 月 17 日
49	《关于旗下部分基金参加国都证券申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 9 月 21 日
50	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 9 月 29 日

	动的公告》		
51	《银华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购的最低金额的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 9 月 30 日
52	《关于增加北京君德汇富投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 10 月 22 日
53	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 10 月 24 日
54	《银华基金关于增加中泰证券为银华高端制造基金代销、定投及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 10 月 29 日
55	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西南证券费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 10 月 30 日
56	《关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销等业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 11 月 3 日
57	《银华基金关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 11 月 5 日
58	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 11 月 16 日
59	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报及本基	2015 年 11 月 16 日

	下部分基金参加上海长量基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	金管理人网站	
60	《银华基金关于参加诺亚正行基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 17 日
61	《关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 25 日
62	《银华基金管理有限公司关于增加光大证券为银华多利宝货币市场基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 28 日
63	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 2 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 28 日
64	《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 2 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 28 日
65	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加哈尔滨银行网上申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 31 日
66	《银华基金关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整情况的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 13.1.2 《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 13.1.4 《银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 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。

13.3 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3月25日