

# 银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>

---

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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华鑫锐定增灵活配置混合
场内简称	银华鑫锐
基金主代码	161834
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 1 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	1,622,371,621.44 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	2016 年 9 月 23 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在基金合同生效后三年内（含第三年），通过对定向增发项目的深入研究，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资，力争为投资人获取稳健的投资收益。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>本基金在基金合同生效后三年内（含第三年），通过对国际和国内宏观经济、行业发展趋势和公司综合竞争力的分析、以及定向增发项目优势的深入研究，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发提升企业盈利水平与推动产业升级作为基金投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。</p> <p>本基金转为上市开放式基金（LOF）后，在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，通过精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益。</p> <p>本基金的投资组合比例为： 基金合同生效后三年内（含第三年），股票资产占基</p>

	金资产的比例为 0%-100%;非公开发行股票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合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 本基金转为上市开放式基金(LOF)后,股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型,其预期收益和风险水平高于债券产品 本基金是混合型,其预期收益和风险水平高于债券产品 货币市场基金,属于中高预期风险、收益的产品。

### 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
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 东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 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	《上海证券报》
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办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-13,641,638.52
本期利润	-18,208,262.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0112
本期加权平均净值利润率	-1.13%
本期基金份额净值增长率	-1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-15,925,099.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0098
期末基金资产净值	1,606,446,522.15
期末基金份额净值	0.990
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-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	0.30%	0.30%	3.01%	0.34%	-2.71%	-0.04%
过去三个月	-1.10%	0.33%	2.97%	0.33%	-4.07%	0.00%
过去六个月	-1.10%	0.26%	4.96%	0.30%	-6.06%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.00%	0.19%	6.22%	0.35%	-7.22%	-0.16%

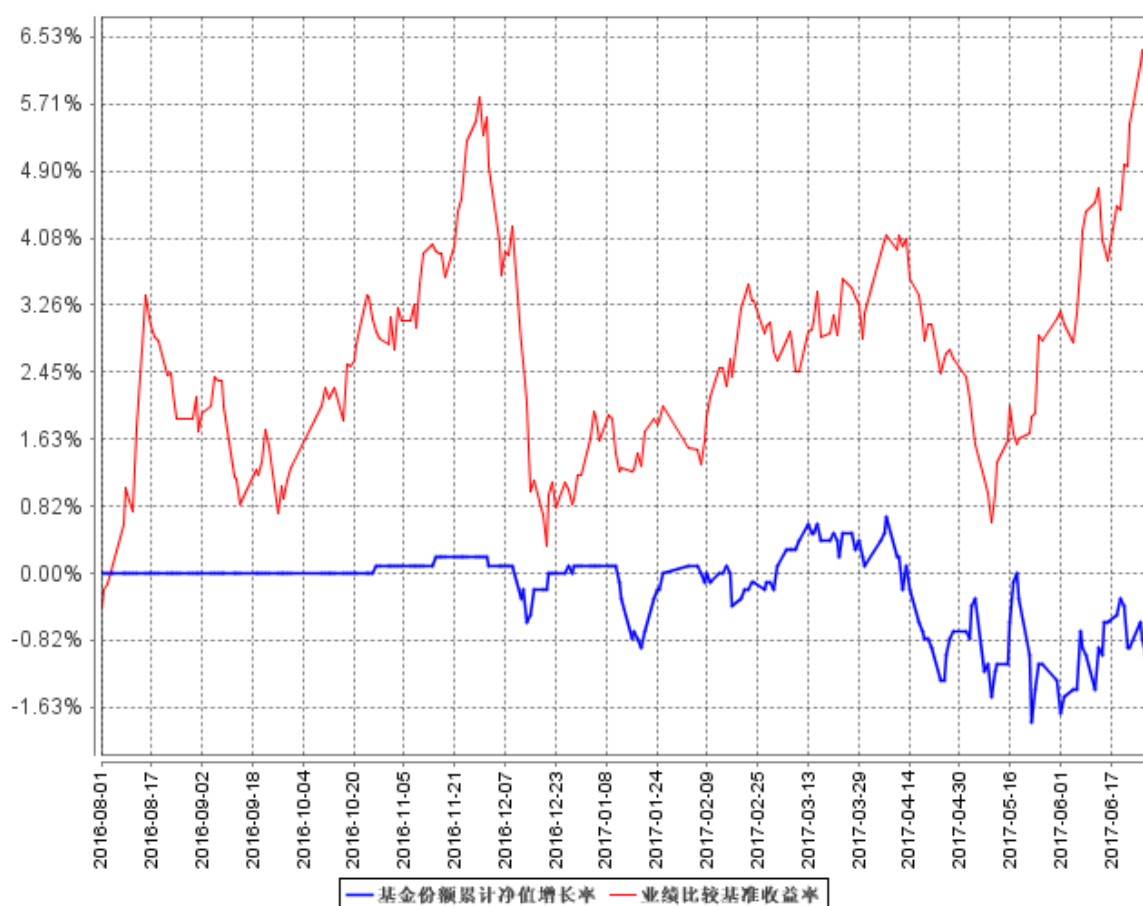
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%



沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖抗操纵性强并且较高知名度和市场影响力。中国债券总指数能够较为全面地反映固定收益市场的状况，具有广泛的市场代表性。综合考虑到本基金大类资产的配置情况和指数代表性，本基金选择沪深 300 指数和中国债券总指数的平均加权作为本基金投资业绩比较标准。

### 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：本基金合同生效日期为 2016 年 8 月 1 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，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：基金合同生效后三年内（含第三年），股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；非公开发行股票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合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 79 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、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、银华双动力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、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、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、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、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、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、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。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		
王鑫钢先生	本基金的基金经理	2016 年 8 月 1 日	-	8 年	硕士学位。2008 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任行业研究员、行业研究组长及基金经理助理职务。自 2013 年 2 月 7 日起担任银华优势企业证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 14 日起兼任银华鑫盛定增灵活配置

					混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 17 日起兼任银华惠安定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 2 日起兼任银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 12 日起兼任银华惠丰定期开放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之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合规守信情况的说明

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、《银华鑫锐定增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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内宏观经济整体运行平稳，一、二季度 GDP 同比增速都为 6.9%。基建投资增速仍维持高位，房地产行业经历了全国性的强力限购政策，但棚改发力三、四线城市去库存，一、二线城市加大供地力度，使得房地产投资仍然维持较高增速，供给侧改革使得工业企业盈利能力大幅提升，其资产负债表进一步修复。全球发达国家的经济继续复苏，出口持续向好。

2017 年上半年，定增市场政策频出。证监会在 2 月对定增出台新规，全部采用发行日首日定价规则，且再融资需间隔 18 个月；5 月底证监会修订发布了《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》；同时沪深交易所分别发布了《上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》（以下简称《减持新规》）。其中，减持上市公司非公开发行股份的，在解禁后 12 个月内不得超过其持股量的 50%；通过大宗交易方式减持股份，在连续 90 个自然日内不得超过公司股份总数的 2%，且受让方在受让后 6 个月内不得转让。定增市场的相关政策对定增市场运行进行了有效而细致的规范，要求上市公司主要参与者（包括大股东、高管和特别投资者）树立价值创造理念，强化机构投资者定价作用，引导价值投资理念，保障资本市场稳定发展，并针对个别机构利用信息优势和资金优势进行一二级市场套利、定向增发逐渐演变成为上市公司资本运作工具的现象进行了有效遏制。

本基金认为，定增新规和减持新规等政策对定增的影响短期偏负面，中长期偏正面。短期来看，定增市场供给方——上市公司的定增项目会减少，从中长期来看还会保证一个稳定的体量；定增市场需求方的数量会因为解禁后流动性问题大大减少。

#### 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 0.990 元，本报告期份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准增长率为 4.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管“减持新规”的背景下，本基金封闭期三年，能确保两年通过二级市场完成减持定增股份。所以下半年，本基金将继续严格审慎的参与定增项目的报价。投资策略方面，首先，控制好择时。在上证综指在 3000 左右点时，加快建仓进度；3300 以上时，放慢建仓节奏。其次，择时还体现在证监会发放定增批文的节奏上。发批文速度慢时，同样放缓建仓，市场哄抢较少的定增标的会减少增发折扣率；发批文速度较快时，加快建仓。第三，短期定增市场参与者由于受到减持新规影响大大减少，导致部分项目的折价率开始提升，本基金将积极参与折价率较大项目的报价。同时，优选适合中国经济未来发展方向、具有优秀管理团队的成长型公司作为核心持仓。

展望未来，在宏观经济转型背景下，所谓加杠杆的间接融资的渠道来加速发展已经进入瓶颈期。新兴产业的快速发展快速崛起，以及传统产业的转型升级都离不开这个增发并购这个直接融资的一个渠道，上市公司增发和并购的需求非常旺盛。其次，在目前流动性充裕并且无风险利率和预期收益率的下降的环境下，定增市场被关注，最主要的原因就是第一它有天然的折价率。第三，定增和并购市场监管是不断趋严，经过过去几年的快速发展，定增和并购市场确实出现了众多乱象，监管更多是为了防范风险，监管趋严，从来都是一个短空长多的影响，有助于整体市场长久的发展。

#### 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**

本基金本报告期末进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，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：银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	847,665,897.00	335,350,798.37
结算备付金		-	61,877,727.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	561,739,981.02	195,460,952.27
其中：股票投资		561,739,981.02	195,460,952.27
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		199,999,985.35	1,034,874,971.77
应收利息	6.4.7.5	173,522.39	236,041.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,609,579,385.76	1,627,800,490.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,641,110.37	2,747,293.94
应付托管费		330,138.81	343,411.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	161,614.43	55,000.00
负债合计		3,132,863.61	3,145,705.68
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,622,371,621.44	1,622,371,621.44
未分配利润	6.4.7.10	-15,925,099.29	2,283,163.62
所有者权益合计		1,606,446,522.15	1,624,654,785.06
负债和所有者权益总计		1,609,579,385.76	1,627,800,490.74

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.990 元，基金份额总额为 1,622,371,621.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-59,310.22
1.利息收入		3,952,348.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,952,348.63
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）		554,965.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	554,965.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,566,624.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		18,148,952.69

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,034,764.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,004,345.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	109,842.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,208,262.91
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,208,262.91

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,622,371,621.44	2,283,163.62	1,624,654,785.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,208,262.91	-18,208,262.91
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（基金净值）	1,622,371,621.44	-15,925,099.29	1,606,446,522.15

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间数据。

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：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]979号《关于准予银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2016年6月27日至2016年7月22日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2016）验字第60468687\_A38号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年8月1日生效。本基金为契约型，在基金合同生效后三年内（含第三年）以参与投资定向增发股票为主要投资目标，基金份额不开放申购、赎回业务，但可上市交易。基金合同生效后第三个年度对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），并更名为银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF），接受场内、场外申购与赎回等业务，并继续上市交易，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币1,621,977,092.56元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币394,528.88元。以上实收基金合计为人民币1,622,371,621.44元，折合1,622,371,621.44份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、非金融企业债务融资工具、同业存单、银行存款、现金、权证、股指期货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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：基金合同生效后三年内（含第三年），股票资产占基金资产的比例为0%-100%；非公开发行股票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合约需缴纳的交易保证金后，本基金

应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

#### 6.4.6.3 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	847,665,897.00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	847,665,897.00

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	563,345,651.34	561,739,981.02	-1,605,670.32
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	563,345,651.34	561,739,981.02	-1,605,670.32



**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	173,522.39
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	173,522.39

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	161,614.43

合计	161,614.43
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,622,371,621.44	1,622,371,621.44
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	1,622,371,621.44	1,622,371,621.44

#### 6.4.7.10 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	-677,790.45	2,960,954.07	2,283,163.62
本期利润	-13,641,638.52	-4,566,624.39	-18,208,262.91
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,319,428.97	-1,605,670.32	-15,925,099.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	3,898,022.19
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	54,326.44
其他	-

合计	3,952,348.63
----	--------------

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金于本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金于本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	554,965.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	554,965.54

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,566,624.39
——股票投资	-4,566,624.39
——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	-4,566,624.39
----	---------------

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：本基金于本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	49,588.57
银行费用	1,727.93
债券帐户维护费	1,500.00
上市费	29,752.78
合计	109,842.36

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 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重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未有发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 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
银华基金管理股份有限公司	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间，本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.1 关联方报酬

###### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,034,764.73
其中：支付销售机构的客户维护费	4,178,288.99

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 2.00%的年费率计提。（基金合同生效后第三个年度对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF）后的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。）计算方法如下：

$$H = E \times 2.00\% / \text{当年天数}$$

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

###### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,004,345.60

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当期天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

**6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间，本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间，本基金的基金管理人于本报告期间未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

**6.4.10.4 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	847,665,897.00	3,898,022.19

注：本基金于 2016 年 8 月 1 日成立，无上年度可比期间。

**6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.6 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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	可流通日	流通受限	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

	名称	日期	日期	类型						
000778	新兴铸管	2017年4月5日	2018年4月6日	非公开发行流通受限	5.15	5.52	29,126,214	150,000,002.10	160,776,701.28	-
300422	博世科	2016年10月26日	2017年11月2日	非公开发行流通受限	36.20	15.55	7,600,751	109,999,998.80	118,191,678.05	-
002171	楚江新材	2017年1月19日	2018年1月20日	非公开发行流通受限	15.05	14.83	5,980,066	89,999,993.30	88,684,378.78	-
002040	南京港	2017年1月18日	2018年1月19日	非公开发行流通受限	14.84	15.94	4,521,563	67,099,994.92	72,073,714.22	-
300437	清水源	2016年9月14日	2017年9月22日	非公开发行流通受限	23.40	18.21	3,525,641	82,499,999.40	64,201,922.61	-
002250	联化科技	2017年1月17日	2018年1月18日	非公开发行流通受限	15.96	14.30	3,584,962	57,215,993.52	51,264,956.60	-
600738	兰州民百	2017年6月21日	2018年6月21日	非公开发行流通受限	7.70	7.72	848,009	6,529,669.30	6,546,629.48	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 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，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，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 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	847,665,897.00	-	-	-	-	-	847,665,897.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	561,739,981.02	561,739,981.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	199,999,985.35	199,999,985.35
应收利息	-	-	-	-	-	173,522.39	173,522.39
资产总计	847,665,897.00	-	-	-	-	761,913,488.76	1,609,579,385.76
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,641,110.37	2,641,110.37
应付托管费	-	-	-	-	-	330,138.81	330,138.81
其他负债	-	-	-	-	-	161,614.43	161,614.43
负债总计	-	-	-	-	-	3,132,863.61	3,132,863.61
利率敏感度缺口	847,665,897.00	-	-	-	-	758,780,625.15	1,606,446,522.15
上年度末 2016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	335,350,798.37	-	-	-	-	-	335,350,798.37
结算备付金	61,877,727.27	-	-	-	-	-	61,877,727.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	195,460,952.27	195,460,952.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,034,874,971.77	1,034,874,971.77
应收利息	-	-	-	-	-	236,041.06	236,041.06

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	397,228,525.64	-	-	-	-	1,230,571,965.10	1,627,800,490.74
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,747,293.94	2,747,293.94
应付托管费	-	-	-	-	-	343,411.74	343,411.74
其他负债	-	-	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,145,705.68	3,145,705.68
利率敏感度缺口	397,228,525.64	-	-	-	-	-1,227,426,259.42	1,624,654,785.06

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此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。

#### 6.4.13.4.2 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。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、非金融企业债务融资工具、同业存单、银行存款、现金、权证、股指期货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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：基金合同生效后三年内（含第三年），股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；非公开发行股票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合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

## 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	561,739,981.02	34.97	195,460,952.27	12.03
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	561,739,981.02	34.97	195,460,952.27	12.03

## 6.4.13.4.2.2 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 系数是根据自基金成立日至本报告期末所有交易日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（如基金成立日至期末不足一个年度的，以基金成立日至期末所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出）。		
	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）	
分析		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	11,049,856.75	-
	-5%	-11,049,856.75	-

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。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	561,739,981.02	34.90
	其中：股票	561,739,981.02	34.90
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	847,665,897.00	52.66
7	其他各项资产	200,173,507.74	12.44
8	合计	1,609,579,385.76	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	364,927,959.27	22.72
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	6,546,629.48	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	72,073,714.22	4.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	118,191,678.05	7.36

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	561,739,981.02	34.97

## 7.2.2 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沪港深股票投资。

## 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

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	000778	新兴铸管	29,126,214	160,776,701.28	10.01
2	300422	博世科	7,600,751	118,191,678.05	7.36
3	002171	楚江新材	5,980,066	88,684,378.78	5.52
4	002040	南京港	4,521,563	72,073,714.22	4.49
5	300437	清水源	3,525,641	64,201,922.61	4.00
6	002250	联化科技	3,584,962	51,264,956.60	3.19
7	600738	兰州民百	848,009	6,546,629.48	0.41

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

## 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	000778	新兴铸管	150,000,002.10	9.23
2	002171	楚江新材	89,999,993.30	5.54
3	002040	南京港	67,099,994.92	4.13
4	002250	联化科技	57,215,993.52	3.52
5	600738	兰州民百	6,529,669.30	0.40

注：本基金本报告期仅买入上述股票。

“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**

注：本基金本报告期末未卖出股票。

**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	370,845,653.14
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期末未卖出股票。

“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投资。

**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投资。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**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投资。

**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	-
2	应收证券清算款	199,999,985.35
3	应收股利	-
4	应收利息	173,522.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,173,507.74

### 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

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	000778	新兴铸管	160,776,701.28	10.01	非公开发行
2	300422	博世科	118,191,678.05	7.36	非公开发行
3	002171	楚江新材	88,684,378.78	5.52	非公开发行
4	002040	南京港	72,073,714.22	4.49	非公开发行
5	300437	清水源	64,201,922.61	4.00	非公开发行
6	002250	联化科技	51,264,956.60	3.19	非公开发行
7	600738	兰州民百	6,546,629.48	0.41	非公开发行

### 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14, 187	114, 356. 21	615, 754, 936. 90	37. 95%	1, 006, 616, 684. 54	62. 05%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国通用技术（集团）控股 有限责任公司	36, 000, 000. 00	6. 29%
2	上海汽车集团股权投资有限 公司—上汽投资—顾瑞 1 号	29, 275, 235. 00	5. 12%
3	上海铂绅投资中心（有限合 伙）—铂绅四号证券投资基 金（私募）	18, 341, 099. 00	3. 21%
4	天安人寿保险股份有限公司 —万能产品	15, 318, 790. 00	2. 68%
5	兴业证券股份有限公司	10, 000, 486. 00	1. 75%
6	中国对外经济贸易信托有限 公司—金得量化套利集合资 金信托计划	7, 112, 132. 00	1. 24%
7	江苏亿嘉新材料有限公司	5, 896, 188. 00	1. 03%
8	上海铂绅投资中心（有限合 伙）—铂绅六号证券投资私 募基金	5, 441, 500. 00	0. 95%
9	曾为	5, 403, 477. 00	0. 94%
10	曾松林	5, 029, 909. 00	0. 88%

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	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	17, 003. 16	0. 00%



持有本基金		
-------	--	--

#### 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

基金合同生效日（2016年8月1日）基金份额总额	1,622,371,621.44
本报告期期初基金份额总额	1,622,371,621.44
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	1,622,371,621.44

## § 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

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

本基金本报告期内未变更为基金进行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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国际金 融有限公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销1个交 易单元
中银国际证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公	2	-	-	-	-	-

司						
首创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券（山 东）有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销1个交 易单元
江海证券有 限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增1个交易单元
湘财证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增1个交易单元
天风证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增4个交易单元

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。

3、本基金本报告期末通过交易单元进行股票交易。

### 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

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券、债券回购、权证交易。

### 10.8 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	《银华基金管理股份有限公司2016年12月31日基金净值公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017年1月3日
2	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年1月19日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年1月20日
4	《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年1月21日
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年1月23日
6	《银华鑫锐定增灵活配置混合型基金更新招募说明书摘要（2017年第1号）》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年3月18日
7	《银华鑫锐定增灵活配置混合型基金更新招募说明书（2017年第1号）》	本基金经理人网站	2017年3月18日
8	《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告》	本基金经理人网站	2017年3月31日
9	《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年3月31日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年4月7日
11	《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告》	上海证券报及本基金经理人网站	2017年4月21日

12	《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》	上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 23 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于使用建设银行卡网上直销优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日



## § 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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华鑫锐定增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
- 12.1.2 《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 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。

### 12.3 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日