

银华中国梦 30 股票型证券投资基金 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

§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	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	13
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.....	14
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.....	14
§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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	36
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.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中国梦 30 股票型证券投资基金
基金简称	银华中国梦 30 股票
基金主代码	001163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 29 日
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	1,594,652,777.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极寻找由中国经济发展模式调整和经济 增长方式转型而带来的投资机会，投资于引领和符合 这个转型过程、有望在实现“中国梦”过程中成长为 中国经济未来蓝筹的优质公司，在严格控制投资组合 风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报， 力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在运用资产 配置策略确定大类资产配置比例以有效规避系统性风 险的基础上，精选经济转型中符合“新战略、新模式、 新发展”方向、具有良好的公司治理水平、具备可持 续增长潜力和合理估值水平的上市公司，通过集中投 资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+中债总财富指数收益率 ×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于证券投资基金中 较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险和 预期收益水平高于混合型证券投资基金、债券型证券 投资基金及货币市场基金。

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	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
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	银华基金管理股份有限公司	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	-5,058,504.52
本期利润	212,068,486.80
加权平均基金份额本期利润	0.1305
本期加权平均净值利润率	14.36%
本期基金份额净值增长率	15.41%
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	-210,460,498.32
期末可供分配基金份额利润	-0.1320
期末基金资产净值	1,564,873,828.14
期末基金份额净值	0.981
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	-1.90%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.98%	0.82%	4.69%	0.57%	2.29%	0.25%
过去三个月	5.83%	0.86%	2.77%	0.59%	3.06%	0.27%
过去六个月	15.41%	0.81%	6.18%	0.54%	9.23%	0.27%
过去一年	12.76%	0.81%	10.16%	0.63%	2.60%	0.18%
自基金合同生效起至今	-1.90%	1.65%	-20.24%	1.71%	18.34%	-0.06%

注：中证 800 指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%。中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。中债总财富指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。中债总财富指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征和资产配置结构。

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：本基金所持有的股票占基金资产的比例为 80%-95%；其中投资于本基金界定的符合“新战略、新模式、新发展”的 30 只上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
薄官辉先生	本基金的基金经理	2015 年 4 月 29 日	-	12 年	硕士学位。2004 年 7 月至 2006 年 5 月任职于长江证券股份有限公司研究所，任研究员，从事农业、食品饮料行业研究。2006 年 6 月至 2009 年 5 月，任职于中信证券股份有限公司研究部，任高级研究员，从事农业、食品饮料行业研究。2009 年 6 月加入银华基金管理有限公司研究部，曾任消费组食品饮料

					行业研究员、大宗商品组研究主管、研究部总监助理、研究部副总监，自 2016 年 11 月 7 日起兼任银华高端制造业灵活配置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、《银华中国梦 30 股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 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

上半年市场对宏观经济的预期可谓一波三折。年初市场的预期是 PPI 价格指数见顶，导致从 2016 年下半年开始的随着大宗商品价格上涨而开始的补库存周期结束，宏观经济增长短期见顶，经济重新进入下行阶段。对宏观经济的悲观预期叠加管理层加强金融监管、推进金融去杠杆，导致市场资金利率系统性提高。但是从 2017 年 6 月份开始，伴随着三四线地产销售超预期以及上半年地产开工数据较好，经济数据表明宏观经济继续向好，年初悲观的预期被修正。

从流动性方面看，美联储分别在 2017 年 3 月和 6 月两次加息，并且暗示将要收缩资产负债表，国内资金利率也比年初有系统性的上升。

证券市场的表现在上半年表现差异明显，年初在对宏观经济预期悲观、资金利率上行的背景下，资金保持了对景气度高的白酒、家电、电子、家装等估值合理、业绩增速比较确定业绩白马股的偏好，上证 50 指数表现优异。而从 2017 年 6 月起，随着对宏观经济悲观预期的修正，叠加供给侧改革的影响，估值受到压抑的投资品如钢铁、煤炭和有色等行业上涨明显。

本报告期的市场走势符合上季度报告中对结构性机会的判断，而且重点持仓仍然集中在白酒、家电、电子等行业中，通过深度研究发掘个股、集中持仓，本基金充分享受到了市场的上涨，本报告期基金净值上涨 15.41%。

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 0.981 元，本报告期份额净值增长率为 15.41%，同期业绩比较基准收益率为 6.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，我们对中国经济增长比较乐观。首先是内生动力比较强，三四线城市地产的旺销、棚改货币化的推进带动地产投资超预期；下半年中国共产党“十九大”的召开推动改革深化，继续推动经济增长。从外部来看，美欧经济复苏带动中国出口变好，对中国经济增长形成比较大的拉动。

我们对 2017 年下半年市场充满信心。从市场总体来看，经济数据维持高位带动悲观预期被修

正，而且资金利率的不再上升已经改变了年初以来的偏向白马的结构性行情，热点会发散到其他的行业和板块。从公司质地来看，经过供给侧改革，周期性行业的利润大幅增长，这些企业的资产负债表得到较好的修复，资产质量得到明显提高；消费品企业继续受益于居民消费升级。从大类资产配置的角度看，目前资金投资方向比较缺乏，景气度高、成长快、估值合理的上市公司股票在全社会资产中属于较优质的资产。

展望本基金 2017 年下半年的操作，行业景气度、公司业绩增速和估值三者的合理搭配是我们选择投资标的首要标准，这些公司集中在白酒、家电、电子、家装、新能源汽车以及受益于供给侧改革的行业。我们将密切跟踪经济复苏的状况，及时调整配置结构，选择最具成长性的行业，精选个股，重点投向在实现中国梦过程中真正成长为国民经济支柱企业的上市公司，争取实现基金资产的保值增值。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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，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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中国梦 30 股票型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	231,802,813.88	210,623,506.18
结算备付金		2,469,676.40	7,024,412.73
存出保证金		802,393.89	948,406.44
交易性金融资产	6.4.7.2	1,337,476,146.38	1,269,467,874.31
其中：股票投资		1,337,476,146.38	1,269,467,874.31
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		-	19,782,562.06
应收利息	6.4.7.5	42,690.09	45,294.09
应收股利		-	-
应收申购款		21,177.81	19,745.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,572,614,898.45	1,507,911,801.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	71,799,011.88
应付赎回款		3,767,298.90	2,252,488.77
应付管理人报酬		1,845,060.67	1,856,200.73
应付托管费		307,510.13	309,366.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,636,492.97	3,531,416.98

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	184,707.64	194,322.75
负债合计		7,741,070.31	79,942,807.91
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,594,652,777.43	1,679,272,588.69
未分配利润	6.4.7.10	-29,778,949.29	-251,303,594.99
所有者权益合计		1,564,873,828.14	1,427,968,993.70
负债和所有者权益总计		1,572,614,898.45	1,507,911,801.61

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.981 元，基金份额总额 1,594,652,777.43 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中国梦 30 股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		232,531,096.61	-230,704,355.10
1.利息收入		745,493.83	829,354.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	745,493.83	823,228.43
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		-	6,125.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,577,439.12	-206,230,121.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,529,539.33	-211,260,228.76
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	9,047,899.79	5,030,107.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	217,126,991.32	-25,489,556.55
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	81,172.34	185,968.92

减：二、费用		20,462,609.81	23,224,974.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,962,586.93	11,244,147.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,827,097.86	1,874,024.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,550,277.30	9,991,700.18
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	122,647.72	115,101.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		212,068,486.80	-253,929,329.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		212,068,486.80	-253,929,329.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中国梦 30 股票型证券投资基金

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）	1,679,272,588.69	-251,303,594.99	1,427,968,993.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	212,068,486.80	212,068,486.80
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）	-84,619,811.26	9,456,158.90	-75,163,652.36
其中：1. 基金申购款	67,173,733.30	-2,256,454.38	64,917,278.92
2. 基金赎回款	-151,793,544.56	11,712,613.28	-140,080,931.28
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）	1,594,652,777.43	-29,778,949.29	1,564,873,828.14

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	1,843,224,768.71	15,981,251.77	1,859,206,020.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-253,929,329.34	-253,929,329.34
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)	-22,678,419.08	2,168,385.09	-20,510,033.99
其中：1.基金申购款	74,069,766.61	-13,120,783.89	60,948,982.72
2.基金赎回款	-96,748,185.69	15,289,168.98	-81,459,016.71
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)	1,820,546,349.63	-235,779,692.48	1,584,766,657.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王立新	_____ 凌宇翔	_____ 龚飒
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

银华中国梦 30 股票型证券投资基金（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[2015]402 号《关于准予银华中国梦 30 股票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 2015 年 4 月 13 日至 2015 年 4 月 24 日向社会公开募集，基金合同于 2015 年 4 月 29 日生效，首次设立募集规模为 2,660,777,422.23 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，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

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、中期票据、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)、股指期货与权证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。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:本基金所持有的股票占基金资产的比例为 80%-95%;其中投资于本基金界定的符合“新战略、新模式、新发展”的 30 只上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果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。业绩比较基准:中证 800 指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年度上半年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

本基金本报告期间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	231,802,813.88
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	231,802,813.88

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	1,126,313,155.10	1,337,476,146.38	211,162,991.28
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	1,126,313,155.10	1,337,476,146.38	211,162,991.28

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：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无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	40,195.63
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	1,111.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,021.96
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	361.10
合计	42,690.09

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,636,492.97

银行间市场应付交易费用	-
合计	1,636,492.97

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	488.09
预提费用	184,219.55
合计	184,707.64

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	1,679,272,588.69	1,679,272,588.69
本期申购	67,173,733.30	67,173,733.30
本期赎回(以“-”号填列)	-151,793,544.56	-151,793,544.56
- 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	1,594,652,777.43	1,594,652,777.43

注：本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中含转换出份额及金额。

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	-217,148,431.38	-34,155,163.61	-251,303,594.99
本期利润	-5,058,504.52	217,126,991.32	212,068,486.80
本期基金份额交易产生的变动数	11,746,437.58	-2,290,278.68	9,456,158.90
其中：基金申购款	-8,978,947.60	6,722,493.22	-2,256,454.38
基金赎回款	20,725,385.18	-9,012,771.90	11,712,613.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-210,460,498.32	180,681,549.03	-29,778,949.29

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	698,704.85
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	38,155.95
其他	8,633.03
合计	745,493.83

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,597,480,992.25
减：卖出股票成本总额	2,591,951,452.92
买卖股票差价收入	5,529,539.33

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金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	9,047,899.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,047,899.79

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	217,126,991.32
——股票投资	217,126,991.32
——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	217,126,991.32

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	75,596.35
转换费收入	5,575.99
合计	81,172.34

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,550,277.30
银行间市场交易费用	-
合计	7,550,277.30

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	44,630.98
信息披露费	49,588.57
债券帐户维护费	18,600.00
银行费用	9,828.17
合计	122,647.72

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，本基金并无需做披露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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
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
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、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券	261,375,209.86	5.19%	-	-
西南证券	59,116,711.08	1.17%	-	-
第一创业	291,570,089.13	5.78%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	243,419.81	5.40%	243,419.81	14.87%
西南证券	55,054.98	1.22%	55,054.98	3.36%
第一创业	271,540.71	6.03%	-	-

注：本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,962,586.93	11,244,147.83
其中：支付销售机构的客户维护费	4,900,179.53	6,347,824.77

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,827,097.86	1,874,024.63

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	231,802,813.88	698,704.85	203,920,657.76	763,253.58

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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**

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 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
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事项	16.92	-	-	862,110	14,845,266.68	14,586,901.20	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场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、

结算备付金及存出保证金等。

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	231,802,813.88	-	-	-	-	-	231,802,813.88
结算备付金	2,469,676.40	-	-	-	-	-	2,469,676.40
存出保证金	802,393.89	-	-	-	-	-	802,393.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,337,476,146.38	-1,337,476,146.38
应收利息	-	-	-	-	-	42,690.09	42,690.09
应收申购款	-	-	-	-	-	21,177.81	21,177.81
资产总计	235,074,884.17	-	-	-	-	-1,337,540,014.28	1,572,614,898.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,767,298.90	3,767,298.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,845,060.67	1,845,060.67
应付托管费	-	-	-	-	-	307,510.13	307,510.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,636,492.97	1,636,492.97
其他负债	-	-	-	-	-	184,707.64	184,707.64
负债总计	-	-	-	-	-	7,741,070.31	7,741,070.31
利率敏感度缺口	235,074,884.17	-	-	-	-	-1,329,798,943.97	1,564,873,828.14
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	210,623,506.18	-	-	-	-	-	210,623,506.18
结算备付金	7,024,412.73	-	-	-	-	-	7,024,412.73
存出保证金	948,406.44	-	-	-	-	-	948,406.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,269,467,874.31	-1,269,467,874.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,782,562.06	19,782,562.06
应收利息	-	-	-	-	-	45,294.09	45,294.09
应收申购款	-	-	-	-	-	19,745.80	19,745.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	218,596,325.35	-	-	-	-	-1,289,315,476.26	1,507,911,801.61
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	71,799,011.88	71,799,011.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,252,488.77	2,252,488.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,856,200.73	1,856,200.73
应付托管费	-	-	-	-	-	309,366.80	309,366.80

应付交易费用	-	-	-	-	-	3,531,416.98	3,531,416.98
其他负债	-	-	-	-	-	194,322.75	194,322.75
负债总计	-	-	-	-	-	79,942,807.91	79,942,807.91
利率敏感度缺口	218,596,325.35	-	-	-	-	-1,209,372,668.35	1,427,968,993.70

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：本基金于报告期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、中期票据、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）、股指期货与权证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。基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票占基金资产的比例为 80%-95%；其中投资于本基金界定的符合“新战略、新模式、新发展”的 30 只上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	1,337,476,146.38	85.47	1,269,467,874.31	88.90

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	1,337,476,146.38	85.47	1,269,467,874.31	88.90

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（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）。		
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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	80,736,724.70	89,062,870.51
	-5%	-80,736,724.70	-89,062,870.51

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	1,337,476,146.38	85.05
	其中：股票	1,337,476,146.38	85.05
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	234,272,490.28	14.90
7	其他各项资产	866,261.79	0.06
8	合计	1,572,614,898.45	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	1,123,940,413.72	71.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	57,919,888.60	3.70
F	批发和零售业	48,101,392.56	3.07
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	-	-
J	金融业	31,315,166.10	2.00
K	房地产业	66,913,655.00	4.28
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	9,285,630.40	0.59

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,337,476,146.38	85.47

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通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	187,591	88,514,813.35	5.66
2	000858	五粮液	1,468,533	81,738,546.78	5.22
3	002475	立讯精密	2,709,449	79,224,288.76	5.06
4	000568	泸州老窖	1,503,460	76,045,006.80	4.86
5	002185	华天科技	9,333,062	67,571,368.88	4.32
6	600048	保利地产	6,711,500	66,913,655.00	4.28
7	000333	美的集团	1,526,174	65,686,528.96	4.20
8	002035	华帝股份	2,592,803	62,745,832.60	4.01
9	002250	联化科技	4,253,212	60,820,931.60	3.89
10	600298	安琪酵母	2,336,296	60,439,977.52	3.86
11	600068	葛洲坝	5,153,015	57,919,888.60	3.70
12	300136	信维通信	1,232,148	49,310,562.96	3.15
13	600584	长电科技	3,055,073	49,033,921.65	3.13
14	601933	永辉超市	6,793,982	48,101,392.56	3.07
15	603515	欧普照明	1,311,909	47,386,153.08	3.03
16	000910	大亚圣象	1,772,285	44,023,559.40	2.81
17	603808	歌力思	1,380,932	40,765,112.64	2.61
18	002415	海康威视	1,236,619	39,942,793.70	2.55
19	603833	欧派家居	355,442	39,048,858.12	2.50
20	600036	招商银行	1,309,710	31,315,166.10	2.00
21	601689	拓普集团	699,712	23,433,354.88	1.50
22	603898	好莱客	645,413	22,557,184.35	1.44
23	002050	三花智控	1,348,900	22,014,048.00	1.41
24	600702	沱牌舍得	716,900	19,076,709.00	1.22

25	002572	索菲亚	448,980	18,408,180.00	1.18
26	600703	三安光电	928,560	18,292,632.00	1.17
27	600690	青岛海尔	1,184,300	17,823,715.00	1.14
28	000915	山大华特	417,038	15,376,191.06	0.98
29	300145	中金环境	862,110	14,586,901.20	0.93
30	000888	峨眉山 A	731,152	9,285,630.40	0.59
31	000651	格力电器	1,779	73,241.43	0.00

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	600702	沱牌舍得	101,223,569.60	7.09
2	000980	众泰汽车	96,709,554.79	6.77
3	002589	瑞康医药	81,332,971.62	5.70
4	002185	华天科技	74,150,899.87	5.19
5	601689	拓普集团	72,855,261.92	5.10
6	601117	中国化学	72,721,523.60	5.09
7	600690	青岛海尔	68,769,601.18	4.82
8	603808	歌力思	68,677,535.73	4.81
9	600048	保利地产	68,613,762.80	4.80
10	002475	立讯精密	68,453,728.65	4.79
11	300136	信维通信	64,161,270.09	4.49
12	000998	隆平高科	62,347,031.22	4.37
13	600068	葛洲坝	61,074,941.70	4.28
14	002250	联化科技	60,338,415.90	4.23
15	603833	欧派家居	59,990,270.47	4.20
16	002024	苏宁云商	58,754,086.87	4.11
17	600584	长电科技	57,424,948.22	4.02
18	000703	恒逸石化	57,265,540.95	4.01
19	002456	欧菲光	56,799,425.19	3.98
20	000881	中广核技	56,669,990.10	3.97
21	601155	新城控股	51,238,734.13	3.59
22	600884	杉杉股份	49,468,551.75	3.46
23	603515	欧普照明	48,069,455.04	3.37

24	601933	永辉超市	44,369,941.60	3.11
25	600376	首开股份	43,967,282.68	3.08
26	600115	东方航空	43,744,985.17	3.06
27	600688	上海石化	43,232,248.14	3.03
28	000910	大亚圣象	41,462,238.69	2.90
29	600703	三安光电	37,083,734.18	2.60
30	002415	海康威视	37,066,934.46	2.60
31	002493	荣盛石化	34,265,916.42	2.40
32	600298	安琪酵母	33,694,676.72	2.36
33	300009	安科生物	31,499,128.20	2.21
34	600036	招商银行	30,363,762.40	2.13
35	300033	同花顺	30,208,140.00	2.12
36	601601	中国太保	30,197,047.79	2.11
37	600021	上海电力	30,136,998.60	2.11
38	002195	二三四五	29,969,463.31	2.10
39	002035	华帝股份	29,644,482.96	2.08
40	601233	桐昆股份	28,621,069.91	2.00

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	113,838,808.74	7.97
2	002589	瑞康医药	86,423,523.88	6.05
3	600702	沱牌舍得	84,467,625.32	5.92
4	000980	众泰汽车	81,377,051.60	5.70
5	600690	青岛海尔	74,265,278.45	5.20
6	600104	上汽集团	72,853,026.79	5.10
7	300033	同花顺	69,639,944.25	4.88
8	600031	三一重工	68,801,161.68	4.82
9	002554	惠博普	67,836,014.76	4.75
10	000630	铜陵有色	67,835,311.89	4.75
11	601117	中国化学	63,752,690.83	4.46
12	000970	中科三环	61,668,997.80	4.32
13	000998	隆平高科	61,334,970.41	4.30

14	002229	鸿博股份	60,558,647.97	4.24
15	600298	安琪酵母	60,064,185.94	4.21
16	000881	中广核技	59,173,159.38	4.14
17	600998	九州通	57,072,205.74	4.00
18	601155	新城控股	57,051,870.18	4.00
19	000703	恒逸石化	56,409,929.66	3.95
20	002024	苏宁云商	55,866,712.60	3.91
21	601689	拓普集团	55,314,483.12	3.87
22	002462	嘉事堂	49,518,389.99	3.47
23	002239	奥特佳	48,570,623.80	3.40
24	000338	潍柴动力	46,935,928.24	3.29
25	600884	杉杉股份	46,169,378.93	3.23
26	000568	泸州老窖	45,320,247.71	3.17
27	300136	信维通信	45,047,684.43	3.15
28	600688	上海石化	44,781,982.54	3.14
29	600115	东方航空	44,303,828.62	3.10
30	600376	首开股份	44,026,809.22	3.08
31	000858	五粮液	38,035,543.43	2.66
32	002493	荣盛石化	35,244,596.76	2.47
33	300097	智云股份	32,598,881.80	2.28
34	002195	二三四五	30,576,784.80	2.14
35	000333	美的集团	30,195,938.49	2.11
36	600021	上海电力	29,519,531.29	2.07
37	000157	中联重科	29,475,328.44	2.06
38	300009	安科生物	29,373,332.65	2.06
39	600068	葛洲坝	29,286,760.80	2.05
40	601601	中国太保	28,944,798.39	2.03
41	000521	美菱电器	28,932,819.30	2.03

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,442,832,733.67
卖出股票收入（成交）总额	2,597,480,992.25

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	802,393.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,690.09
5	应收申购款	21,177.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	866,261.79

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

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。

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
25,845	61,700.63	50,657,548.12	3.18%	1,543,995,229.31	96.82%

8.2 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	37,380.77	0.00%

8.3 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月29日）基金份额总额	2,660,777,422.23
本报告期期初基金份额总额	1,679,272,588.69
本报告期基金总申购份额	67,173,733.30
减：本报告期基金总赎回份额	151,793,544.56
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	1,594,652,777.43

注：本期申购中含转换入份额，本期赎回中含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内，本基金未变更为其审计的会计事务所。

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
天风证券股 份有限公司	4	879,336,269.77	17.45%	789,998.84	17.53%	新增 4 个 交易单元
华泰证券股 份有限公司	5	507,443,373.04	10.07%	371,091.54	8.24%	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	427,163,926.11	8.47%	397,818.12	8.83%	-
中国国际金 融有限公司	2	362,109,593.85	7.18%	337,232.82	7.48%	-
招商证券股 份有限公司	2	323,162,855.70	6.41%	300,964.28	6.68%	-
第一创业证 券股份有限 公司	2	291,570,089.13	5.78%	271,540.71	6.03%	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	289,881,793.28	5.75%	269,970.47	5.99%	-
东北证券股 份有限公司	4	261,375,209.86	5.19%	243,419.81	5.40%	-
东吴证券股 份有限公司	3	230,285,649.62	4.57%	168,409.25	3.74%	-
长江证券股 份有限公司	2	226,956,632.49	4.50%	211,364.02	4.69%	-
平安证券有 限责任公司	2	226,498,940.36	4.49%	210,938.75	4.68%	-
广发证券股 份有限公司	2	165,258,734.64	3.28%	153,906.00	3.42%	-
东方证券股 份有限公司	3	156,970,586.32	3.11%	146,186.81	3.24%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	147,267,247.79	2.92%	137,150.53	3.04%	-
华融证券股 份有限公司	1	140,494,267.89	2.79%	130,841.95	2.90%	-
首创证券有 限责任公司	2	126,070,963.04	2.50%	117,410.59	2.61%	-
方正证券股 份有限公司	5	120,088,383.50	2.38%	99,939.41	2.22%	-
西南证券股 份有限公司	2	59,116,711.08	1.17%	55,054.98	1.22%	新增 1 个 交易单元
华创证券有	2	54,138,830.65	1.07%	50,418.91	1.12%	-

限责任公司						
申万宏源集团 股份有限公司	2	45,123,667.80	0.90%	42,022.67	0.93%	-
中国民族证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券(山 东)有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
民生证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
江海证券有 限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
南京证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易、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管理人网站	2017年1月3日
2	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》	证券时报及本基金管理人网站	2017年1月21日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月23日
4	《银华基金关于增加上海华信证券为旗下部分基金代销机构公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月24日
5	《关于旗下部分基金在首创证券开通定期定额投资及转换业务并参加首创证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月27日
6	《关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月28日
7	《关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月28日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月9日
9	《关于旗下部分基金参加上海华信证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月18日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月21日

11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金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	2017 年 3 月 31 日
12	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金 2016 年年度报告》	本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
13	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	证券时报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
14	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》	证券时报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 1 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海通华财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其优惠费率活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 1 日
18	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2017 年 6 月 13 日
19	《银华中国梦 30 股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）》	证券时报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 13 日
20	《关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 22 日
21	《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 银华中国梦 30 股票型证券投资基金基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华中国梦 30 股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《银华中国梦 30 股票型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.4 《银华中国梦 30 股票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 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日