

银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券
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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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.....	7
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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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
§5 托管人报告	16
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
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
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64

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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	银华盛世精选灵活配置混合发起式
基金主代码	003940
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	385,889,928.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选符合中国经济发展方向上具备利润创造能力，并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。本基金为灵活配置混合型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，进行短期的战术避险选择。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有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合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	贺碧波
	联系电话	(010)58163000	(0574)89103198
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	hebibo@nbcbb.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95574
传真		(010)58163027	(0574)89103213
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		100738	315100
法定代表人		王珠林	陆华裕

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	9,153,061.77
本期利润	25,119,134.28
加权平均基金份额本期利润	0.2935
本期加权平均净值利润率	25.19%
本期基金份额净值增长率	26.42%
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	6,035,652.86
期末可供分配基金份额利润	0.0156
期末基金资产净值	437,892,107.58
期末基金份额净值	1.1348
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	26.13%

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。

4、本基金合同生效日为2016年12月22日，本报告期主要财务指标的计算期间为2017年1月1日至2017年6月30日。

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	8.02%	0.88%	3.07%	0.32%	4.95%	0.56%
过去三个月	9.81%	0.90%	1.69%	0.34%	8.12%	0.56%
过去六个月	26.42%	0.81%	3.53%	0.31%	22.89%	0.50%
自基金合同生效起至今	26.13%	0.79%	3.47%	0.30%	22.66%	0.49%

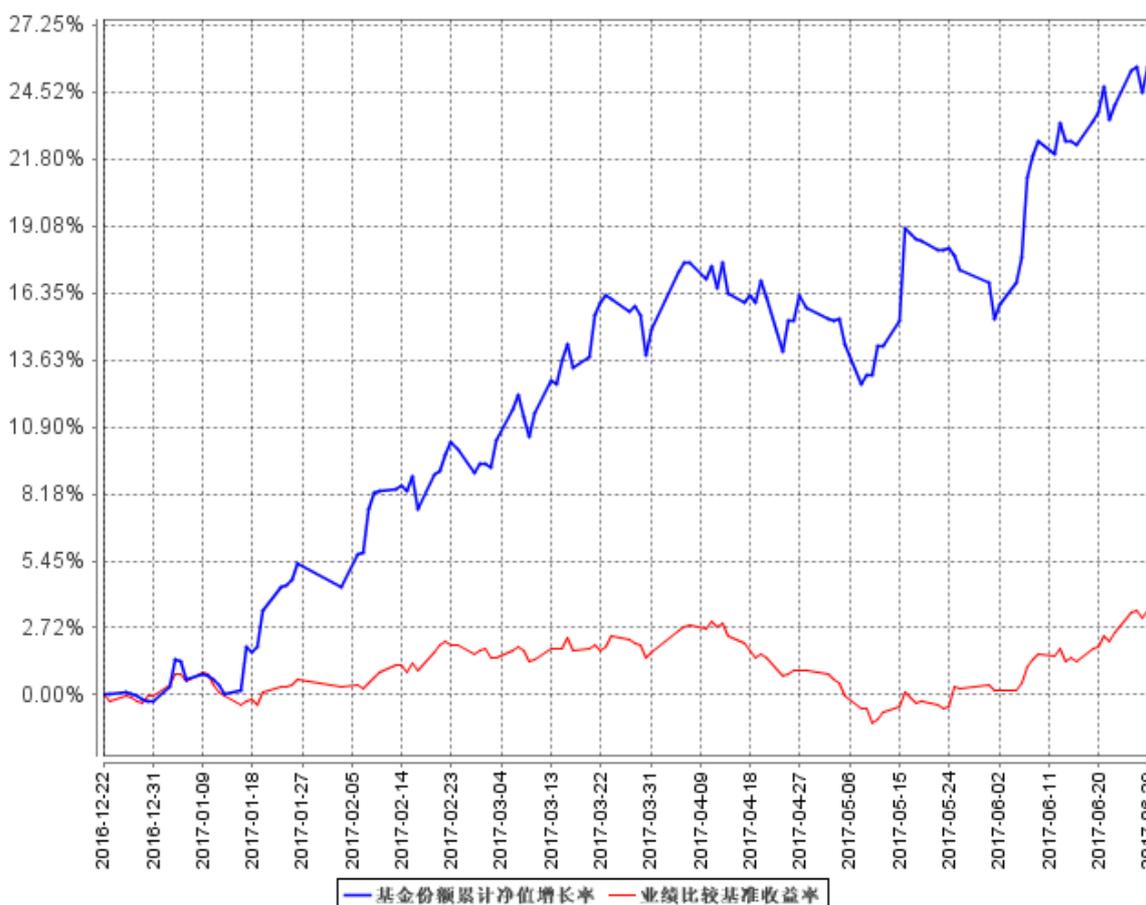
注：中证800指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。具有一定的权威性和市场代表性。因此，中证 800 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

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 12 月 22 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：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、

股指期货等金融工具；本基金持有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合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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		
李晓星先生	本基金的基金经理	2016 年 12 月 22 日	-	5 年	硕士学位，2006 年至 2010 年期间任职于 ABB 有限公司，历任运营发展部运营顾问，集团审计部高级审计师等职务；2011 年 2 月加盟银华基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理职务。自 2015 年 7 月 7 日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 11 日起兼任银华明

					择多策略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、《银华盛世精选灵活配置混合发起式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，市场触底反弹，除了一线白马龙头继续保持较好的超额收益外，行情开始逐步扩散至二线品种。市场投资者的情绪逐渐稳定，开始将主要精力放在精选行业和个股的方向。行业维持高景气的家电、白酒、消费电子等涨幅居前，市场的赚钱效应持续。我们在二季度维持了较高的仓位，坚定持有了景气向上行业中优质的上市公司，取得了不错的回报。截止到二季度末，我们的仓位主要配置在食品饮料、家电、生物医药、清洁能源、高端制造等行业。

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 1.1348 元，本报告期份额净值增长率为 26.42%，同期业绩比较基准收益率为 3.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为三季度政策和基本面都相对平稳，对行情继续保持乐观，判断市场仍会震荡向上。由于临近中报发布期，我们将重点配置中报业绩增速快且估值相对匹配的个股。选择的行业主要集中在食品、轻工、电子、家电、传媒等偏消费的领域。在不发生新的增量利空的情况下，我们会维持偏高的仓位，力争通过精选行业和个股的方式来给持有人带来绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2017 年 6 月 22 日发布分红公告，向于 2017 年 6 月 26 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 1.2430 元，实际分配收益金额为人民币 46,926,032.49 元。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2016 年 12 月 22 日至 2017 年 4 月 5 日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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

本报告期内（2017 年上半年），本托管人在《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金》的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、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

本报告期内（2017 年上半年），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，对本基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配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。

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。其中第六节 6.4.10.2.1 基金管理费中支付销售机构的客户维护费、第八节基金份额持有人信息以管理人数据为准。

§ 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：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	33,706,602.10	1,796,001.02
结算备付金		2,006,024.74	-
存出保证金		211,615.58	-
交易性金融资产	6.4.7.2	397,379,872.28	2,510,999.00
其中：股票投资		397,379,872.28	2,510,999.00
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	-	17,200,000.00
应收证券清算款		4,203,705.13	245,806.50
应收利息	6.4.7.5	34,690.71	12,850.08
应收股利		-	-
应收申购款		1,979,036.60	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		439,521,547.14	21,765,656.60
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		-	-
应付赎回款		239,514.94	-
应付管理人报酬		340,375.26	8,039.43
应付托管费		56,729.19	1,339.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	920,742.30	3,134.47

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	72,077.87	-
负债合计		1,629,439.56	12,513.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	385,889,928.80	21,804,110.23
未分配利润	6.4.7.10	52,002,178.78	-50,967.42
所有者权益合计		437,892,107.58	21,753,142.81
负债和所有者权益总计		439,521,547.14	21,765,656.60

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1348 元，基金份额总额 385,889,928.80 份。

6.2 利润表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
一、收入		27,817,621.51
1.利息收入		100,849.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	92,587.75
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		8,261.90
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,656,091.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,702,091.29
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	953,999.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,966,072.51
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	94,608.12
减：二、费用		2,698,487.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	714,983.25

2. 托管费	6.4.10.2.2	119,163.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,792,436.06
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	71,904.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,119,134.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,119,134.28

注：本基金于 2016 年 12 月 22 日成立，因此无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	21,804,110.23	-50,967.42	21,753,142.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,119,134.28	25,119,134.28
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）	364,085,818.57	73,860,044.41	437,945,862.98
其中：1.基金申购款	374,002,549.81	75,645,370.14	449,647,919.95
2.基金赎回款	-9,916,731.24	-1,785,325.73	-11,702,056.97
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）	-	-46,926,032.49	-46,926,032.49
五、期末所有者权益（基金净值）	385,889,928.80	52,002,178.78	437,892,107.58

注：本基金于 2016 年 12 月 22 日成立，因此无上年度可比期间。

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

银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(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】2738 号文《关于准予银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2016 年 12 月 12 日至 2016 年 12 月 16 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期,募集期间净认购资金总额为人民币 21,802,102.62 元,在募集期间产生的利息为人民币 2,007.61 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 21,804,110.23 元,折合 21,804,110.23 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。经向中国证监会备案后,基金合同于 2016 年 12 月 22 日生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资对象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(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(包含国债、金融债券、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、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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的相关规定);本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%—95%,其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货等金融工具;本基金持有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合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的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%。本基金的业绩比较基准是:中证 800

指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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本报告期末的财务状况以及本报告期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

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债

券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（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利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。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初始取得成本时，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初始取得成本时，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) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘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；

(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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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收益/（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，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 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票面利率计算的金额，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），在回购期内逐日计提；

(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，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金基本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）在回购期内逐日计提；
- (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。如果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。

6.4.4.11 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，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投方式免收再投资的费用；
- 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。

6.4.4.12 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

(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》，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。

(2) 营业税、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》，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，继续免征营业税和企业所得税；

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》，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》，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。

(3) 个人所得税

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》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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》，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；

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》，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《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》，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。

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	33,706,602.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	33,706,602.10

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	381,462,676.77	397,379,872.28	15,917,195.51
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	381,462,676.77	397,379,872.28	15,917,195.51

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/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	25,497.11
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	902.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	8,195.60
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	95.30
合计	34,690.71

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

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	920,742.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	920,742.30

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	173.81

预提费用	71,904.06
合计	72,077.87

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	21,804,110.23	21,804,110.23
本期申购	374,002,549.81	374,002,549.81
本期赎回(以“-”号填列)	-9,916,731.24	-9,916,731.24
- 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	385,889,928.80	385,889,928.80

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。

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	-2,090.42	-48,877.00	-50,967.42
本期利润	9,153,061.77	15,966,072.51	25,119,134.28
本期基金份额交易产生的变动数	43,810,714.00	30,049,330.41	73,860,044.41
其中：基金申购款	44,949,654.42	30,695,715.72	75,645,370.14
基金赎回款	-1,138,940.42	-646,385.31	-1,785,325.73
本期已分配利润	-46,926,032.49	-	-46,926,032.49
本期末	6,035,652.86	45,966,525.92	52,002,178.78

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
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	6,838.06

其他	12,472.80
合计	92,587.75

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	466,070,226.16
减：卖出股票成本总额	455,368,134.87
买卖股票差价收入	10,702,091.29

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	953,999.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	953,999.94

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	15,966,072.51
——股票投资	15,966,072.51
——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	15,966,072.51

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	91,120.27
转换费收入	3,487.85
合计	94,608.12

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	1,792,436.06
银行间市场交易费用	-
合计	1,792,436.06

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	22,315.49
信息披露费	49,588.57
合计	71,904.06

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，本基金无需做披露的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者其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于 2016 年 12 月 22 日成立，因此无上年度可比期间。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

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
当期发生的基金应支付的管理费	714,983.25
其中：支付销售机构的客户维护费	74,293.05

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 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	119,163.86

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月起 2-5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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。

6.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	10,001,200.12
期初持有的基金份额	10,001,200.12
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,001,200.12
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.59%

注：本基金的管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。本基金于 2016 年 12 月 22 日成立，因此无上年度可比期间。

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：本基金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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行	33,706,602.10	73,276.89

注：本基金于 2016 年 12 月 22 日成立，因此无上年度可比期间。

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：本基金本报告期末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

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2017年 6月26 日	-	2017 年6月 26日	1.2430	43,210,934.01	3,715,098.48	46,926,032.49	
合计	-	-		1.2430	43,210,934.01	3,715,098.48	46,926,032.49	

注：本基金管理人于 2017 年 6 月 22 日发布分红公告，向于 2017 年 6 月 26 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 1.2430 元，实际分配收益金额为人民币 46,926,032.49 元。

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持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	-	-	478,100	7,935,768.60	8,089,452.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	259,100	878,071.00	888,713.00	-
002175	东方网络	2017年3月9日	重大事项	14.25	2017年7月13日	14.74	19,500	322,725.00	277,875.00	-

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及结算备付金等。

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	33,706,602.10	-	-	-	-	-	33,706,602.10
结算备付金	2,006,024.74	-	-	-	-	-	2,006,024.74
存出保证金	211,615.58	-	-	-	-	-	211,615.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-397,379,872.28	397,379,872.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,203,705.13	4,203,705.13
应收利息	-	-	-	-	-	34,690.71	34,690.71
应收申购款	1,699.83	-	-	-	-	1,977,336.77	1,979,036.60
资产总计	35,925,942.25	-	-	-	-	-403,595,604.89	439,521,547.14
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	239,514.94	239,514.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	340,375.26	340,375.26
应付托管费	-	-	-	-	-	56,729.19	56,729.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	920,742.30	920,742.30
其他负债	-	-	-	-	-	72,077.87	72,077.87
负债总计	-	-	-	-	-	1,629,439.56	1,629,439.56
利率敏感度缺口	35,925,942.25	-	-	-	-	-401,966,165.33	437,892,107.58
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	1,796,001.02	-	-	-	-	-	1,796,001.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,510,999.00	2,510,999.00
买入返售金融资产	17,200,000.00	-	-	-	-	-	17,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	245,806.50	245,806.50
应收利息	-	-	-	-	-	12,850.08	12,850.08
资产总计	18,996,001.02	-	-	-	-	2,769,655.58	21,765,656.60
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,039.43	8,039.43
应付托管费	-	-	-	-	-	1,339.89	1,339.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,134.47	3,134.47
负债总计	-	-	-	-	-	12,513.79	12,513.79
利率敏感度缺口	18,996,001.02	-	-	-	-	2,757,141.79	21,753,142.81

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

本基金于本报告期末及上年度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（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（包括国债、金融债券、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、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、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的相关规定）。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有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合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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	397,379,872.28	90.75	2,510,999.00	11.54
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	397,379,872.28	90.75	2,510,999.00	11.54

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。	
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）
	+5%	41,885,468.54
	-5%	-41,885,468.54

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	397,379,872.28	90.41
	其中：股票	397,379,872.28	90.41
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	35,712,626.84	8.13
7	其他各项资产	6,429,048.02	1.46
8	合计	439,521,547.14	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	306,823,078.07	70.07
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	22,500,863.75	5.14
G	交通运输、仓储和邮政业	17,534,783.28	4.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,635,813.54	8.37
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	11,277.60	0.00
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	13,874,056.04	3.17
S	综合	-	-
	合计	397,379,872.28	90.75

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	300274	阳光电源	2,503,913	27,768,395.17	6.34
2	000568	泸州老窖	409,610	20,718,073.80	4.73
3	000858	五粮液	366,338	20,390,373.08	4.66
4	603898	好莱客	520,839	18,203,323.05	4.16
5	300013	新宁物流	1,052,508	17,534,783.28	4.00
6	002831	裕同科技	233,572	17,517,900.00	4.00
7	300021	大禹节水	2,050,386	16,833,669.06	3.84
8	000651	格力电器	372,600	15,339,942.00	3.50
9	000997	新大陆	629,466	14,282,583.54	3.26
10	002640	跨境通	637,585	13,548,681.25	3.09
11	300115	长盈精密	439,850	12,834,823.00	2.93
12	000967	盈峰环境	1,118,313	12,122,512.92	2.77
13	603368	柳州医药	156,370	8,952,182.50	2.04
14	002343	慈文传媒	234,314	8,871,128.04	2.03
15	300113	顺网科技	324,400	8,726,360.00	1.99
16	600056	中国医药	334,222	8,673,060.90	1.98
17	002138	顺络电子	462,798	8,598,786.84	1.96
18	603027	千禾味业	462,400	8,549,776.00	1.95
19	600702	沱牌舍得	317,000	8,435,370.00	1.93
20	002436	兴森科技	1,334,000	8,404,200.00	1.92
21	002334	英威腾	1,149,700	8,335,325.00	1.90
22	300145	中金环境	478,100	8,089,452.00	1.85

23	600703	三安光电	397,713	7,834,946.10	1.79
24	002425	凯撒文化	851,774	7,785,214.36	1.78
25	000739	普洛药业	1,054,008	7,736,418.72	1.77
26	002517	恺英网络	184,700	6,499,593.00	1.48
27	002236	大华股份	281,437	6,419,577.97	1.47
28	600197	伊力特	277,320	5,416,059.60	1.24
29	600373	中文传媒	212,800	5,002,928.00	1.14
30	603337	杰克股份	116,034	4,490,515.80	1.03
31	300170	汉得信息	430,500	4,438,455.00	1.01
32	300232	洲明科技	273,450	4,375,200.00	1.00
33	002449	国星光电	262,860	4,350,333.00	0.99
34	300207	欣旺达	363,900	4,290,381.00	0.98
35	603600	永艺股份	260,100	4,281,246.00	0.98
36	002304	洋河股份	49,100	4,262,371.00	0.97
37	600779	水井坊	168,909	4,151,783.22	0.95
38	600809	山西汾酒	112,814	3,913,517.66	0.89
39	002241	歌尔股份	192,154	3,704,729.12	0.85
40	000799	酒鬼酒	195,500	3,593,290.00	0.82
41	000596	古井贡酒	69,900	3,561,405.00	0.81
42	002101	广东鸿图	108,630	2,595,170.70	0.59
43	300588	熙菱信息	69,300	2,410,947.00	0.55
44	300214	日科化学	351,300	2,357,223.00	0.54
45	000100	TCL 集团	259,100	888,713.00	0.20
46	002175	东方网络	19,500	277,875.00	0.06
47	000888	峨眉山 A	888	11,277.60	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	300021	大禹节水	34,122,979.70	156.86
2	300274	阳光电源	33,473,867.65	153.88
3	600196	复星医药	29,132,544.83	133.92
4	603898	好莱客	20,063,353.15	92.23
5	000568	泸州老窖	19,502,926.60	89.66
6	000997	新大陆	18,809,410.37	86.47

7	000651	格力电器	18,717,462.00	86.04
8	000858	五粮液	17,728,355.84	81.50
9	002831	裕同科技	17,048,814.99	78.37
10	300013	新宁物流	15,889,906.66	73.05
11	600809	山西汾酒	15,551,283.37	71.49
12	002640	跨境通	13,972,419.47	64.23
13	002343	慈文传媒	13,241,849.87	60.87
14	600056	中国医药	13,206,258.98	60.71
15	000967	盈峰环境	12,771,316.78	58.71
16	300115	长盈精密	12,561,309.95	57.74
17	000739	普洛药业	10,790,604.22	49.60
18	600702	沱牌舍得	10,764,612.86	49.49
19	002138	顺络电子	10,406,539.08	47.84
20	000895	双汇发展	9,543,974.03	43.87
21	300113	顺网科技	9,508,832.74	43.71
22	002425	凯撒文化	9,437,146.38	43.38
23	600297	广汇汽车	9,300,395.30	42.75
24	002739	万达院线	9,185,782.00	42.23
25	603368	柳州医药	8,811,200.60	40.51
26	002436	兴森科技	8,629,224.37	39.67
27	002074	国轩高科	8,434,285.75	38.77
28	002466	天齐锂业	8,309,716.00	38.20
29	002334	英威腾	8,266,565.90	38.00
30	603027	千禾味业	7,973,204.05	36.65
31	300588	熙菱信息	7,960,837.00	36.60
32	300145	中金环境	7,935,768.60	36.48
33	600703	三安光电	7,882,792.22	36.24
34	300408	三环集团	7,787,969.69	35.80
35	002241	歌尔股份	7,595,015.25	34.91
36	002236	大华股份	7,229,205.50	33.23
37	300214	日科化学	7,194,389.61	33.07
38	600068	葛洲坝	6,602,497.00	30.35
39	002517	恺英网络	6,416,523.98	29.50
40	600197	伊力特	6,131,781.76	28.19
41	002456	欧菲光	5,735,024.15	26.36
42	000049	德赛电池	5,584,284.20	25.67

43	300033	同花顺	5,479,326.29	25.19
44	002449	国星光电	5,164,949.20	23.74
45	600373	中文传媒	5,143,500.00	23.64
46	300232	洲明科技	4,942,231.11	22.72
47	300476	胜宏科技	4,902,195.62	22.54
48	300170	汉得信息	4,876,182.57	22.42
49	002271	东方雨虹	4,806,185.32	22.09
50	002850	科达利	4,766,506.00	21.91
51	600298	安琪酵母	4,758,909.00	21.88
52	300603	立昂技术	4,678,376.00	21.51
53	600779	水井坊	4,588,617.40	21.09
54	600340	华夏幸福	4,459,593.00	20.50
55	300207	欣旺达	4,317,530.00	19.85
56	002304	洋河股份	4,316,554.00	19.84
57	603337	杰克股份	4,301,838.86	19.78
58	603600	永艺股份	4,295,211.45	19.75
59	002202	金风科技	4,231,636.20	19.45
60	000799	酒鬼酒	4,200,202.04	19.31
61	002567	唐人神	4,124,079.89	18.96
62	300373	扬杰科技	3,967,993.68	18.24
63	001979	招商蛇口	3,896,925.00	17.91
64	000596	古井贡酒	3,801,732.54	17.48
65	002174	游族网络	3,783,818.12	17.39
66	002027	分众传媒	3,763,925.00	17.30
67	600585	海螺水泥	3,732,795.00	17.16
68	000065	北方国际	3,700,152.70	17.01
69	600977	中国电影	3,650,549.00	16.78
70	601668	中国建筑	3,567,816.00	16.40
71	300335	迪森股份	3,494,869.62	16.07
72	601186	中国铁建	3,339,796.85	15.35
73	600021	上海电力	3,166,706.00	14.56
74	002462	嘉事堂	3,137,786.25	14.42
75	000661	长春高新	3,052,164.00	14.03
76	600885	宏发股份	2,844,985.00	13.08
77	000018	神州长城	2,716,619.00	12.49
78	300244	迪安诊断	2,598,410.06	11.94

79	000898	鞍钢股份	2,592,513.44	11.92
80	002008	大族激光	2,582,945.00	11.87
81	603589	口子窖	2,496,965.83	11.48
82	002101	广东鸿图	2,420,171.80	11.13
83	600114	东睦股份	2,414,494.12	11.10
84	300271	华宇软件	2,387,332.57	10.97
85	000401	冀东水泥	2,343,231.00	10.77
86	000725	京东方A	2,327,980.00	10.70
87	002078	太阳纸业	2,294,347.26	10.55
88	000998	隆平高科	2,256,837.00	10.37
89	600148	长春一东	2,209,321.00	10.16
90	601888	中国国旅	2,188,160.00	10.06
91	300190	维尔利	2,175,194.66	10.00
92	000625	长安汽车	2,163,100.00	9.94
93	002475	立讯精密	2,162,730.20	9.94
94	600337	美克家居	2,162,161.40	9.94
95	002510	天汽模	2,140,563.00	9.84
96	000069	华侨城A	2,129,372.00	9.79
97	600584	长电科技	2,069,293.00	9.51
98	600873	梅花生物	2,026,179.00	9.31
99	600535	天士力	1,995,259.56	9.17
100	600519	贵州茅台	1,979,796.92	9.10
101	600338	西藏珠峰	1,969,603.00	9.05
102	600998	九州通	1,931,680.00	8.88
103	300630	普利制药	1,889,201.00	8.68
104	300287	飞利信	1,877,063.73	8.63
105	603040	新坐标	1,819,678.00	8.37
106	603979	金诚信	1,785,290.00	8.21
107	002068	黑猫股份	1,755,137.00	8.07
108	600079	人福医药	1,753,407.00	8.06
109	600019	宝钢股份	1,753,220.00	8.06
110	600889	南京化纤	1,751,058.39	8.05
111	000333	美的集团	1,692,655.00	7.78
112	002185	华天科技	1,608,635.00	7.39
113	600567	山鹰纸业	1,600,439.09	7.36
114	601991	大唐发电	1,599,071.50	7.35

115	600886	国投电力	1,597,141.00	7.34
116	600027	华电国际	1,596,966.00	7.34
117	600011	华能国际	1,595,504.16	7.33
118	600795	国电电力	1,515,396.00	6.97
119	300197	铁汉生态	1,503,528.00	6.91
120	600028	中国石化	1,500,376.00	6.90
121	600801	华新水泥	1,423,143.00	6.54
122	002536	西泵股份	1,412,807.25	6.49
123	603816	顾家家居	1,406,869.00	6.47
124	600966	博汇纸业	1,336,861.00	6.15
125	600594	益佰制药	1,333,052.00	6.13
126	002507	涪陵榨菜	1,312,240.00	6.03
127	600109	国金证券	1,299,275.00	5.97
128	002035	华帝股份	1,268,652.00	5.83
129	601225	陕西煤业	1,256,961.00	5.78
130	600963	岳阳林纸	1,201,505.00	5.52
131	300477	合纵科技	1,195,889.10	5.50
132	000636	风华高科	1,192,747.00	5.48
133	002460	赣锋锂业	1,183,207.00	5.44
134	300058	蓝色光标	1,172,936.00	5.39
135	300219	鸿利智汇	1,170,796.00	5.38
136	600491	龙元建设	1,163,089.00	5.35
137	300203	聚光科技	1,144,997.99	5.26
138	000709	河钢股份	1,101,871.00	5.07
139	300425	环能科技	1,094,295.75	5.03
140	002589	瑞康医药	1,078,182.00	4.96
141	600742	一汽富维	1,038,368.00	4.77
142	000807	云铝股份	994,999.00	4.57
143	600884	杉杉股份	954,522.00	4.39
144	002635	安洁科技	943,176.00	4.34
145	603609	禾丰牧业	943,044.00	4.34
146	600502	安徽水利	941,251.50	4.33
147	300136	信维通信	939,984.68	4.32
148	601766	中国中车	938,855.00	4.32
149	002340	格林美	937,082.60	4.31
150	002217	合力泰	935,331.90	4.30

151	002196	方正电机	933,946.00	4.29
152	600308	华泰股份	933,603.00	4.29
153	002714	牧原股份	930,682.00	4.28
154	601390	中国中铁	921,239.00	4.23
155	002521	齐峰新材	912,396.00	4.19
156	002422	科伦药业	912,065.00	4.19
157	300559	佳发安泰	903,068.00	4.15
158	300235	方直科技	885,510.00	4.07
159	600782	新钢股份	879,653.00	4.04
160	000100	TCL 集团	878,071.00	4.04
161	002737	葵花药业	873,826.00	4.02
162	300303	聚飞光电	872,545.00	4.01
163	601633	长城汽车	871,845.00	4.01
164	000753	漳州发展	864,763.00	3.98
165	002108	沧州明珠	842,496.00	3.87
166	000878	云南铜业	827,052.00	3.80
167	002775	文科园林	816,499.00	3.75
168	600872	中炬高新	766,725.00	3.52
169	601601	中国太保	676,502.00	3.11
170	601628	中国人寿	675,654.00	3.11
171	002043	兔 宝 宝	674,928.00	3.10
172	601899	紫金矿业	668,610.00	3.07
173	600881	亚泰集团	667,281.00	3.07
174	000797	中国武夷	665,508.40	3.06
175	601233	桐昆股份	664,857.00	3.06
176	601699	潞安环能	664,466.00	3.05
177	600549	厦门钨业	660,975.00	3.04
178	600759	洲际油气	658,932.00	3.03
179	600201	生物股份	658,623.00	3.03
180	601155	新城控股	645,307.00	2.97
181	000786	北新建材	643,217.30	2.96
182	603008	喜临门	630,386.00	2.90
183	002611	东方精工	624,011.00	2.87
184	002376	新北洋	607,035.00	2.79
185	300068	南都电源	585,590.00	2.69
186	600104	上汽集团	555,430.00	2.55

187	600741	华域汽车	551,159.00	2.53
188	300169	天晟新材	542,924.00	2.50
189	002502	骅威文化	528,761.00	2.43
190	600030	中信证券	485,640.00	2.23
191	601377	兴业证券	485,298.00	2.23
192	600837	海通证券	484,796.00	2.23
193	002127	南极电商	445,161.00	2.05
194	600099	林海股份	439,464.00	2.02
195	601688	华泰证券	435,236.00	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	600196	复星医药	29,779,441.62	136.90
2	300021	大禹节水	19,870,134.19	91.34
3	600809	山西汾酒	12,582,643.50	57.84
4	002466	天齐锂业	10,511,456.51	48.32
5	000895	双汇发展	9,799,120.03	45.05
6	002739	万达院线	9,319,100.84	42.84
7	600297	广汇汽车	9,276,494.45	42.64
8	002074	国轩高科	9,098,998.62	41.83
9	300408	三环集团	7,899,696.05	36.32
10	300274	阳光电源	7,818,722.20	35.94
11	002456	欧菲光	6,239,342.50	28.68
12	000997	新大陆	5,942,739.53	27.32
13	600068	葛洲坝	5,771,613.75	26.53
14	000049	德赛电池	5,765,839.38	26.51
15	300033	同花顺	5,418,189.00	24.91
16	002271	东方雨虹	5,312,624.24	24.42
17	600298	安琪酵母	5,149,818.26	23.67
18	300588	熙菱信息	4,711,339.26	21.66
19	002850	科达利	4,705,413.83	21.63
20	600056	中国医药	4,591,269.47	21.11
21	300476	胜宏科技	4,533,562.60	20.84
22	600340	华夏幸福	4,504,177.40	20.71
23	002567	唐人神	4,493,411.92	20.66

24	002241	歌尔股份	4,468,178.79	20.54
25	300214	日科化学	4,372,185.33	20.10
26	002343	慈文传媒	4,196,421.69	19.29
27	300373	扬杰科技	4,165,258.15	19.15
28	002202	金风科技	4,163,449.36	19.14
29	002174	游族网络	4,129,224.90	18.98
30	002027	分众传媒	4,068,847.42	18.70
31	300603	立昂技术	3,994,171.72	18.36
32	600585	海螺水泥	3,860,110.12	17.75
33	000651	格力电器	3,767,694.55	17.32
34	000065	北方国际	3,725,637.89	17.13
35	001979	招商蛇口	3,631,168.58	16.69
36	601668	中国建筑	3,397,858.00	15.62
37	600977	中国电影	3,368,171.27	15.48
38	300335	迪森股份	3,321,774.41	15.27
39	000739	普洛药业	3,206,493.16	14.74
40	601186	中国铁建	3,179,719.32	14.62
41	600885	宏发股份	3,061,992.50	14.08
42	600021	上海电力	3,055,031.00	14.04
43	000661	长春高新	3,043,868.78	13.99
44	002462	嘉事堂	3,035,052.32	13.95
45	002236	大华股份	2,820,866.48	12.97
46	300244	迪安诊断	2,782,706.43	12.79
47	002008	大族激光	2,739,873.00	12.60
48	000898	鞍钢股份	2,637,855.80	12.13
49	600702	沱牌舍得	2,601,394.26	11.96
50	000018	神州长城	2,509,395.00	11.54
51	603589	口子窖	2,484,797.42	11.42
52	000725	京东方A	2,469,402.00	11.35
53	000401	冀东水泥	2,442,196.68	11.23
54	600114	东睦股份	2,435,723.00	11.20
55	300271	华宇软件	2,420,719.47	11.13
56	603898	好莱客	2,341,553.42	10.76
57	002078	太阳纸业	2,324,491.64	10.69
58	600338	西藏珠峰	2,309,900.00	10.62
59	000998	隆平高科	2,300,765.06	10.58
60	600148	长春一东	2,279,133.00	10.48
61	601888	中国国旅	2,267,200.00	10.42

62	002510	天汽模	2,212,781.00	10.17
63	002475	立讯精密	2,187,165.00	10.05
64	000625	长安汽车	2,172,712.00	9.99
65	600337	美克家居	2,135,582.62	9.82
66	000069	华侨城 A	2,132,405.48	9.80
67	600519	贵州茅台	2,112,824.00	9.71
68	600873	梅花生物	2,007,407.20	9.23
69	600535	天士力	1,992,185.00	9.16
70	002138	顺络电子	1,987,580.28	9.14
71	300287	飞利信	1,976,967.00	9.09
72	600998	九州通	1,968,840.24	9.05
73	600584	长电科技	1,939,668.07	8.92
74	603040	新坐标	1,908,857.87	8.78
75	300190	维尔利	1,890,805.00	8.69
76	002068	黑猫股份	1,824,412.00	8.39
77	600019	宝钢股份	1,793,092.00	8.24
78	600889	南京化纤	1,776,779.25	8.17
79	300630	普利制药	1,775,546.55	8.16
80	300197	铁汉生态	1,690,929.33	7.77
81	600567	山鹰纸业	1,652,882.00	7.60
82	600079	人福医药	1,643,138.00	7.55
83	000333	美的集团	1,636,094.00	7.52
84	600801	华新水泥	1,632,571.00	7.50
85	002425	凯撒文化	1,630,867.00	7.50
86	601991	大唐发电	1,618,649.00	7.44
87	603979	金诚信	1,616,809.00	7.43
88	002185	华天科技	1,610,598.42	7.40
89	600886	国投电力	1,576,333.00	7.25
90	600011	华能国际	1,565,884.27	7.20
91	600966	博汇纸业	1,548,641.00	7.12
92	603609	禾丰牧业	1,541,669.38	7.09
93	600027	华电国际	1,487,111.79	6.84
94	600795	国电电力	1,482,290.00	6.81
95	600028	中国石化	1,474,489.75	6.78
96	603816	顾家家居	1,466,454.00	6.74
97	002035	华帝股份	1,451,805.80	6.67
98	002536	西泵股份	1,438,860.55	6.61
99	000967	盈峰环境	1,362,772.91	6.26

100	002460	赣锋锂业	1,361,991.00	6.26
101	600594	益佰制药	1,355,099.65	6.23
102	300219	鸿利智汇	1,337,511.76	6.15
103	002507	涪陵榨菜	1,321,254.50	6.07
104	601225	陕西煤业	1,287,338.00	5.92
105	600109	国金证券	1,285,820.00	5.91
106	300477	合纵科技	1,205,186.83	5.54
107	300231	银信科技	1,161,894.00	5.34
108	600491	龙元建设	1,148,413.00	5.28
109	300058	蓝色光标	1,147,644.14	5.28
110	600963	岳阳林纸	1,126,285.25	5.18
111	000709	河钢股份	1,124,026.24	5.17
112	000636	风华高科	1,122,646.00	5.16
113	300203	聚光科技	1,107,991.04	5.09
114	300425	环能科技	1,102,366.04	5.07
115	002589	瑞康医药	1,089,894.00	5.01
116	002340	格林美	1,088,441.00	5.00
117	300232	洲明科技	1,082,994.00	4.98
118	002217	合力泰	1,080,428.40	4.97
119	002196	方正电机	1,053,137.67	4.84
120	300136	信维通信	1,046,580.55	4.81
121	600197	伊力特	1,027,791.34	4.72
122	000807	云铝股份	1,002,000.00	4.61
123	600742	一汽富维	975,454.00	4.48
124	600884	杉杉股份	967,942.20	4.45
125	002635	安洁科技	967,080.00	4.45
126	600502	安徽水利	963,585.00	4.43
127	002737	葵花药业	961,411.00	4.42
128	002449	国星光电	958,723.51	4.41
129	300303	聚飞光电	953,251.76	4.38
130	002521	齐峰新材	951,420.00	4.37
131	300235	方直科技	950,190.76	4.37
132	601766	中国中车	931,695.00	4.28
133	600308	华泰股份	920,202.00	4.23
134	000753	漳州发展	917,701.00	4.22
135	002714	牧原股份	914,152.00	4.20
136	002422	科伦药业	912,875.00	4.20
137	300559	佳发安泰	911,023.00	4.19

138	002108	沧州明珠	910,507.00	4.19
139	601390	中国中铁	899,701.00	4.14
140	600782	新钢股份	895,439.00	4.12
141	601633	长城汽车	883,847.00	4.06
142	002775	文科园林	864,827.00	3.98
143	000878	云南铜业	835,263.00	3.84
144	002640	跨境通	809,602.00	3.72
145	600872	中炬高新	807,691.00	3.71
146	300113	顺网科技	785,483.00	3.61
147	600779	水井坊	774,056.00	3.56
148	601155	新城控股	706,837.10	3.25
149	000786	北新建材	678,344.50	3.12
150	601899	紫金矿业	676,362.00	3.11
151	002043	兔宝宝	676,347.00	3.11
152	601233	桐昆股份	675,176.00	3.10
153	601699	潞安环能	670,260.00	3.08
154	600881	亚泰集团	668,777.00	3.07
155	601601	中国太保	667,185.00	3.07
156	002091	江苏国泰	665,352.50	3.06
157	600201	生物股份	661,932.00	3.04
158	600759	洲际油气	661,780.00	3.04
159	601628	中国人寿	658,790.00	3.03
160	002611	东方精工	657,337.48	3.02
161	603008	喜临门	655,059.64	3.01
162	600549	厦门钨业	652,202.00	3.00
163	000797	中国武夷	643,690.49	2.96
164	002376	新北洋	597,597.00	2.75
165	300068	南都电源	586,634.00	2.70
166	600104	上汽集团	551,617.00	2.54
167	600741	华域汽车	548,438.00	2.52
168	300169	天晟新材	545,489.49	2.51
169	002502	骅威文化	529,579.00	2.43
170	000799	酒鬼酒	526,460.00	2.42
171	600837	海通证券	481,145.69	2.21
172	601377	兴业证券	479,358.00	2.20
173	600030	中信证券	476,636.00	2.19
174	002127	南极电商	458,224.00	2.11
175	002140	东华科技	445,143.00	2.05

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	834,270,935.64
卖出股票收入（成交）总额	466,070,226.16

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	211,615.58
2	应收证券清算款	4,203,705.13

3	应收股利	-
4	应收利息	34,690.71
5	应收申购款	1,979,036.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,429,048.02

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
2,663	144,907.97	299,412,045.69	77.59%	86,477,883.11	22.41%

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	2,376,554.26	0.62%

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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,001,200.12	2.59	10,001,200.12	2.59	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,200.12	2.59	10,001,200.12	2.59	3年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,001,200.12 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 1,200.12 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月22日）基金份额总额	21,804,110.23
本报告期期初基金份额总额	21,804,110.23
本报告期基金总申购份额	374,002,549.81
减：本报告期基金总赎回份额	9,916,731.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	385,889,928.80

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本基金由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所为本基金提供审计服务，本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
中信证券股 份有限公司	4	435,833,240.61	33.52%	405,891.37	33.52%	-
光大证券股 份有限公司	2	351,653,048.90	27.04%	327,495.32	27.04%	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	225,052,446.94	17.31%	209,592.03	17.31%	-
安信证券股 份有限公司	4	210,385,479.86	16.18%	195,931.48	16.18%	-
国信证券股 份有限公司	2	77,416,945.49	5.95%	72,097.73	5.95%	-

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	32,800,000.00	100.00%	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	《关于旗下部分基金持有的宝钢股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017年2月11日
3	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年2月17日
4	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年2月24日
5	《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经理人网站	2017年2月28日
6	《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经理人网站	2017年2月28日
7	《关于调整银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务限额的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年3月16日
8	《关于增加上海天天基金销售有限公司为银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年3月16日
9	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加部分代销机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年3月28日
10	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复办理大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年3月30日
11	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在交通银行开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年4月18日
12	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在部分	证券时报及本基金经理人网站	2017年4月19日

	代销机构开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》		
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的东方网络估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017年4月20日
14	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2017年第1季度报告》	证券时报及本基金经理人网站	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经理人网站	2017年4月22日
16	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在中国银行开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年4月28日
17	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在部分代销机构开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务并参加费率优惠活动的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年5月11日
18	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在光大银行开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年5月12日
19	《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经理人网站	2017年6月1日
20	《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经理人网站	2017年6月1日
21	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在部分代销机构开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务并参加费率优惠活动的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年6月15日
22	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金分红公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年6月22日
23	《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经理人网站	2017年6月22日
24	《关于增加包商银行股份有限公司	证券时报及本基金	2017年6月30日

	司为旗下部分基金申购、赎回、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	管理人网站	
25	《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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/01/01-2017/04/09	10,001,200.12	0.00	0.00	10,001,200.12	2.59%
	2	2017/05/25-2017/06/14	0.00	81,349,946.76	0.00	81,349,946.76	21.08%
		2017/06/23-2017/06/30					
3	2017/05/22-2017/05/25	0.00	39,689,208.28	0.00	39,689,208.28	10.29%	
个人	1	2017/01/01-2017/04/10	7,589,857.27	5,075,025.90	0.00	12,664,883.17	3.28%

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2017 年 2 月 17 日披露了《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》，决定自 2017 年 2 月 20 日起，开放申购、赎回、定期定额投资及转换业务。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日