

# 银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 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：2018 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	68
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 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 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>83</b>
13.1 备查文件目录 .....	83
13.2 存放地点 .....	83
13.3 查阅方式 .....	83

## § 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	2,110,141,107.83 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	王海燕
	联系电话	(010)58163000	0574-89103171
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wanghaiyan@nbc.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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	60,230,587.06	-2,090.42
本期利润	187,954,595.12	-50,967.42
加权平均基金份额本期利润	0.2843	-0.0023
本期加权平均净值利润率	22.23%	-0.23%
本期基金份额净值增长率	47.66%	-0.23%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	165,660,660.76	-50,967.42
期末可供分配基金份额利润	0.0785	-0.0023
期末基金资产净值	2,796,916,628.84	21,753,142.81
期末基金份额净值	1.3255	0.9977
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	47.32%	-0.23%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.72%	1.19%	0.86%	0.39%	2.86%	0.80%
过去六个月	16.80%	1.04%	3.93%	0.35%	12.87%	0.69%
过去一年	47.66%	0.94%	7.60%	0.33%	40.06%	0.61%
自基金合同生效起至今	47.32%	0.92%	7.53%	0.33%	39.79%	0.59%

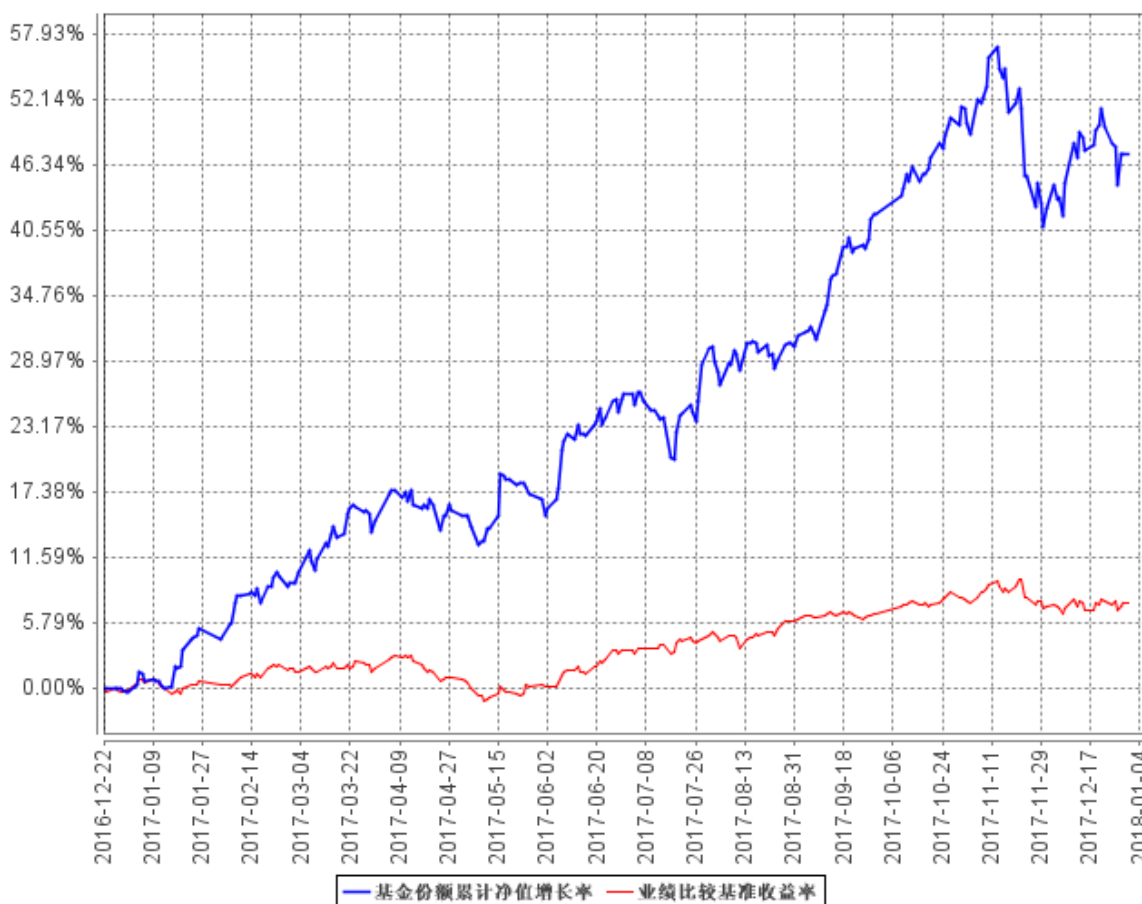
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%

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，其选择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



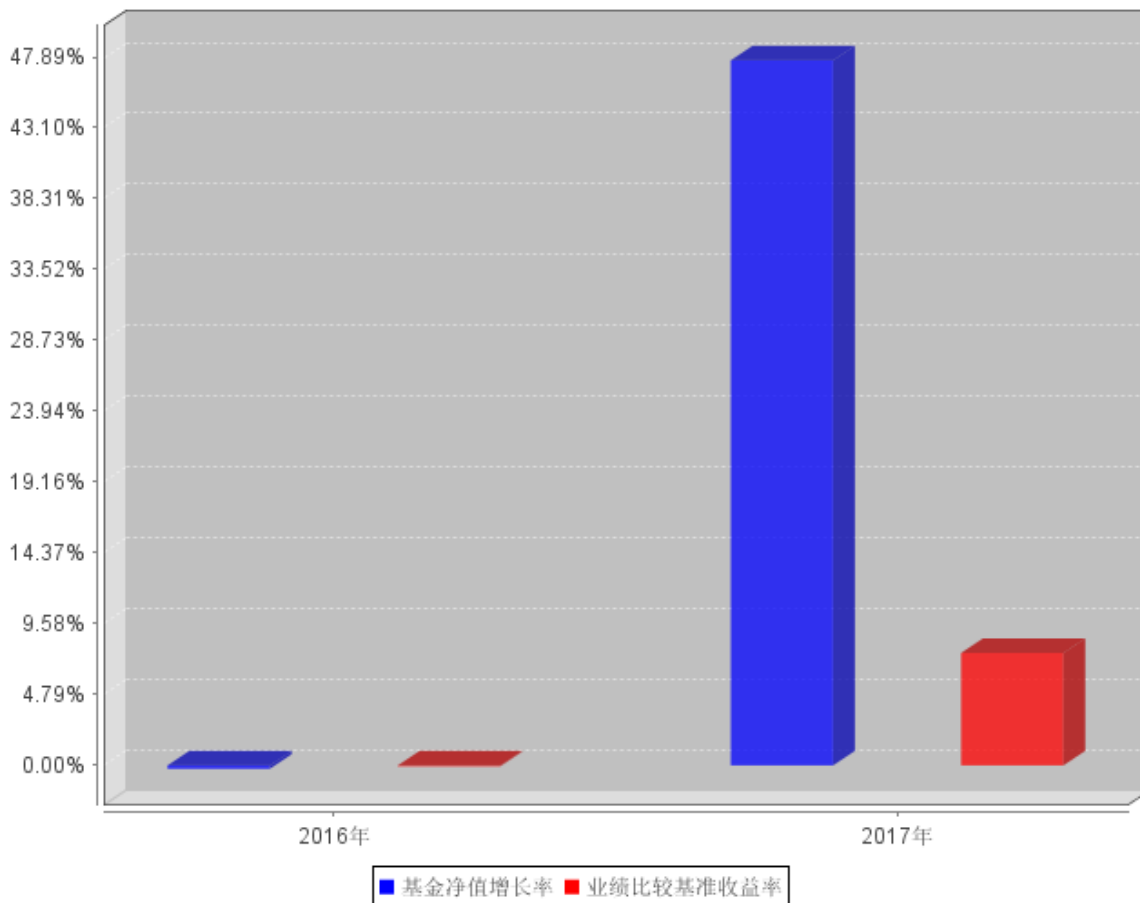
注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金净资产的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府



债券不低于基金资产净值的 5%。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	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	年度利润分配合 计	备注
2017	1.2430	43,210,934.01	3,715,098.48	46,926,032.49	
2016	-	-	-	-	
合计	1.2430	43,210,934.01	3,715,098.48	46,926,032.49	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业股份有限公司 0.90%，杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 90 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、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华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、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金。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	本基金的	2016 年 12 月	-	6 年	硕士学位，2006 年至

生	基金经理	22 日			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，自 2017 年 11 月 3 日起兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 12 日起兼任银华心诚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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》，对投资部、固定收益部、量化投资

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

##### 4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，

公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

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

在投资决策环节，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合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，市场呈现出明显的结构化行情。消费股涨幅领先，周期、金融轮番走强，而科技股则表现较弱。白酒龙头不断上调出厂价，带动白酒及家电等蓝筹公司股价创出新高。同时，在加息周期以及金融监管趋紧的背景下，投资者对于保险及银行的基本面越来越乐观，股价随之走高。而随着周期品去产能告一段落，上半年涨幅较大的周期股有所回撤。另外，苹果下调四季度出货量，造成科技股持续调整。在对整体市场保持乐观的情况下，我们在全年保持高仓位，配置上集中在消费和成长，精选高景气行业中高增长的个股，取得了不错的回报。截止到四季度末，我们的仓位主要配置在食品饮料、新能源、电子、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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3255 元；本报告期基金份额净值增长率为 47.66%，业绩比较基准收益率为 7.60%。

#### 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 2018 年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。未来一段时间我们的选股主线会围绕科技创新和消费升级，自下而上的选择个股为主。由于临近年报发布期，我们将重点配置四季报业绩超预期且估值相对匹配的个股。选择的行业继续主要集中在白酒、家电、新能源、电子、生物医药和高端制造等领域。在不发生新的增量利空的情况下，我们会维持偏高的仓位，力争给持有人带来绝对收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

#### **4.8 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，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。

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

报告期内，本基金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交方案。



## § 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），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的有关规定，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），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、基金费用开支等方面进行了认真地复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内（2017 年），本基金已实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(18)第 P01355 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度及 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度及 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p>

	<p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	文启斯	杨丽
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2018 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	198,011,140.00	1,796,001.02
结算备付金		16,843,183.61	-
存出保证金		1,940,267.16	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,594,142,571.26	2,510,999.00
其中：股票投资		2,594,142,571.26	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	17,200,000.00
应收证券清算款		6,711,177.90	245,806.50
应收利息	7.4.7.5	79,794.53	12,850.08
应收股利		-	-
应收申购款		8,261,466.09	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,825,989,600.55	21,765,656.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,363,972.71	-
应付赎回款		10,621,824.03	-
应付管理人报酬		3,316,333.18	8,039.43
应付托管费		552,722.20	1,339.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,023,010.31	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	7.4.7.8	195,109.28	-
负债合计		29,072,971.71	12,513.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,110,141,107.83	21,804,110.23
未分配利润	7.4.7.10	686,775,521.01	-50,967.42
所有者权益合计		2,796,916,628.84	21,753,142.81
负债和所有者权益总计		2,825,989,600.55	21,765,656.60

注：1：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.3255 元，基金份额为 2,110,141,107.83 份。

2：上年度可比期间为 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 22 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		218,810,765.38	-37,757.09
1. 利息收入		955,117.99	21,156.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	946,856.09	3,480.57
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	17,676.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		80,784,886.60	-10,037.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	78,393,287.04	-10,037.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,391,599.56	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	127,724,008.06	-48,877.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,346,752.73	0.30
<b>减：二、费用</b>		30,856,170.26	13,210.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,266,348.44	8,039.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,044,391.35	1,339.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	16,365,030.47	3,831.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	180,400.00	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		187,954,595.12	-50,967.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		187,954,595.12	-50,967.42

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	187,954,595.12	187,954,595.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,088,336,997.60	545,797,925.80	2,634,134,923.40
其中：1. 基金申购款	3,128,843,026.91	851,885,742.69	3,980,728,769.60
2. 基金赎回款	-1,040,506,029.31	-306,087,816.89	-1,346,593,846.20
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）	2,110,141,107.83	686,775,521.01	2,796,916,628.84

项目	上年度可比期间 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,804,110.23	-	21,804,110.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-50,967.42	-50,967.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	21,804,110.23	-50,967.42	21,753,142.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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》准予募集注册并公开发行,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 $\times$ 50%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 50%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况和 2017 年度及 2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2016

年 12 月 22 日(基金合同生效日)起至 2016 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

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

##### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

第 3 层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

##### 1. 股票投资

###### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

###### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值；

###### (3) 流通受限股票的估值

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

##### 2. 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计 - 续

##### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则 - 续

#### 2. 债券投资 - 续

(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，以第三方估值机构提供的价格数据估值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

#### 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；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

#### 4. 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中的相关原则进行估值。

#### 5. 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

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

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，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。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）和《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发[2017]6号）相关规定，本基金自2017年11月21日起，对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整，新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。该会计估计变更未对本基金本期末的基金资产净值产生重大影响。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

无。

### **7.4.6 税项**

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》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征营业税和增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

(3) 对基金所持上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	198,011,140.00	1,796,001.02
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	198,011,140.00	1,796,001.02

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日



		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,466,467,440.20	2,594,142,571.26	127,675,131.06
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		2,466,467,440.20	2,594,142,571.26	127,675,131.06
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,559,876.00	2,510,999.00	-48,877.00
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		2,559,876.00	2,510,999.00	-48,877.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	17,200,000.00	-
合计	17,200,000.00	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	64,284.49	3,480.57
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	8,337.45	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	9,369.51
应收申购款利息	6,212.07	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	960.52	-
合计	79,794.53	12,850.08

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,023,010.31	3,134.47
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	6,023,010.31	3,134.47

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	15,109.28	-
预提费用	180,000.00	-
合计	195,109.28	-

**7.4.7.9 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12月31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	3,128,843,026.91	3,128,843,026.91
本期赎回（以“-”号填列）	-1,040,506,029.31	-1,040,506,029.31
- 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	2,110,141,107.83	2,110,141,107.83

注：1：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2：本基金于2016年12月12日至2016年12月16日向社会公开募集，截至2016年12月22日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币21,802,102.62元，登记机构计算并确认的有效认购资金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。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,090.42	-48,877.00	-50,967.42
本期利润	60,230,587.06	127,724,008.06	187,954,595.12
本期基金份额交易产生的变动数	152,358,196.61	393,439,729.19	545,797,925.80
其中：基金申购款	229,351,642.94	622,534,099.75	851,885,742.69
基金赎回款	-76,993,446.33	-229,094,370.56	-306,087,816.89
本期已分配利润	-46,926,032.49	-	-46,926,032.49
本期末	165,660,660.76	521,114,860.25	686,775,521.01

**7.4.7.11 存款利息收入**

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12月31日	2016年12月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	815,949.04	3,480.57

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	78,422.27	-
其他	52,484.78	-
合计	946,856.09	3,480.57

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月22日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日
卖出股票成交总额	4,582,846,570.39	397,892.00
减：卖出股票成本总额	4,504,453,283.35	407,929.00
买卖股票差价收入	78,393,287.04	-10,037.00

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月22日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,391,599.56	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,391,599.56	-

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2016年12月22日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	127,724,008.06	-48,877.00
——股票投资	127,724,008.06	-48,877.00
——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	127,724,008.06	-48,877.00

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月22日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	9,212,095.70	-
转换费收入	134,657.03	-
其他	-	0.30
合计	9,346,752.73	0.30

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月22日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	16,365,030.47	3,831.01
银行间市场交易费用	-	-
合计	16,365,030.47	3,831.01

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年	上年度可比期间 2016年12月22日(基金合同
----	-----------------------	-----------------------------

	12 月 31 日	生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	100,000.00	-
其他	400.00	-
合计	180,400.00	-

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部和国家税务总局分别于 2016 年 12 月 21 日联合颁布的《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》(财税[2016]140 号)和 2017 年 6 月 30 日联合颁布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)的有关规定,自 2018 年 1 月 1 日起,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

除以上情况外,本基金无其他需要说明的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人股东
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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
杭州银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
杭州银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
杭州银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	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
宁波银行股份有限公司(“宁波银行”)	基金托管人
银华财富资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注:银华基金管理股份有限公司于 2017 年 12 月 14 日完成公司增资,新增股东杭州银华聚义投资合伙企业(有限合伙)、杭州银华致信投资合伙企业(有限合伙)、杭州银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)成为本基金的关联方。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年12月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,266,348.44	8,039.43
其中：支付销售机构的客户维护费	3,160,771.45	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

###### 7.4.10.2.2 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12月31日	2016年12月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,044,391.35	1,339.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托

管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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	10,001,200.12
期初持有的基金份额	10,001,200.12	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	10,001,200.12
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	45.87%

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、本基金的基金管理人运用固有资金作为发起资金于基金募集期间认购了本基金银华盛世精选灵活配置混合型发起式的基金份额，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。

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

注：无。

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	198,011,140.00	815,949.04	1,796,001.02	3,480.57



**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无

**7.4.11 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	

**7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位： 股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
002027	分众 传媒	2017 年 9 月 29 日	2018 年 3 月 29 日	非公 开发 流 通 受 限	9.10	13.42	2,780,000	25,298,000.00	37,307,600.00	注 2

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

1. 按照中国证监会修订的《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》(证监会公告[2017]9号)的补充规定，持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2. 本基金于 2017 年 9 月 29 日通过大宗交易方式买入分众传媒 2,780,000 股，交易价格为 9.10

元/股，总成本 25,298,000.00 元；交易对手方为分众传媒非公开发行股份的股东，限售期为 6 个月。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300013	新宁物流	2017年11月20日	重大事项	12.95	2018年1月19日	11.71	1,132,010	19,718,652.37	14,659,529.50	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人

定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	198,011,140.00	-	-	-	-	-	198,011,140.00
结算备付金	16,843,183.61	-	-	-	-	-	16,843,183.61
存出保证金	1,940,267.16	-	-	-	-	-	1,940,267.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,594,142,571.26	2,594,142,571.26
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,711,177.90	6,711,177.90
应收利息	-	-	-	-	-	79,794.53	79,794.53
应收申购款	5,566.62	-	-	-	-	8,255,899.47	8,261,466.09
资产总计	216,800,157.39	-	-	-	-	2,609,189,443.16	2,825,989,600.55
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,363,972.71	8,363,972.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,621,824.03	10,621,824.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,316,333.18	3,316,333.18
应付托管费	-	-	-	-	-	552,722.20	552,722.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,023,010.31	6,023,010.31
其他负债	-	-	-	-	-	195,109.28	195,109.28
负债总计	-	-	-	-	-	29,072,971.71	29,072,971.71
利率敏感度缺口	216,800,157.39	-	-	-	-	2,580,116,471.45	2,796,916,628.84
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：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31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	2,594,142,571.26	92.75	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	2,594,142,571.26	92.75	2,510,999.00	11.54

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	306,684,860.56	-
	-5%	-306,684,860.56	-

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

本基金非以公允价值计量的金融工具，公允价值与账面价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,542,175,441.76 元，属于第二层次的余额为人民币 14,659,529.50 元，属于第三层次的余额为人民币 37,307,600.00 元（2016 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 2,510,999.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 37,307,600.00 元；本报告期由第二层次转入第三层次的金额为人民币 36,529,200.00 元，

无转出第三层次的金額，计入公允价值变动损益的金額为人民币 778,400.00 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.15 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 28 日经本基金管理人批准报出。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,594,142,571.26	91.80
	其中：股票	2,594,142,571.26	91.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	214,854,323.61	7.60
8	其他各项资产	16,992,705.68	0.60
9	合计	2,825,989,600.55	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。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,044,503,681.32	73.10
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	14,816,943.90	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	14,659,529.50	0.52
H	住宿和餐饮业	2,812,358.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,517,704.09	3.81
J	金融业	249,195,543.24	8.91
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	113,869,543.04	4.07



M	科学研究和技术服务业	17,953,095.88	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	9,563.76	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	29,804,608.53	1.07
S	综合	-	-
	合计	2,594,142,571.26	92.75

### 8.2.2 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港股通股票投资。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	2,287,754	182,745,789.52	6.53
2	600809	山西汾酒	3,203,177	182,549,057.23	6.53
3	002202	金风科技	9,683,444	182,532,919.40	6.53
4	300274	阳光电源	9,340,165	175,314,897.05	6.27
5	002304	洋河股份	1,472,097	169,291,155.00	6.05
6	002027	分众传媒	8,217,638	113,869,543.04	4.07
7	000568	泸州老窖	1,709,758	112,844,028.00	4.03
8	600702	沱牌舍得	2,254,400	105,190,304.00	3.76
9	002456	欧菲光	5,047,344	103,924,812.96	3.72
10	300323	华灿光电	6,299,224	102,677,351.20	3.67
11	601336	新华保险	1,271,949	89,290,819.80	3.19
12	000651	格力电器	1,858,600	81,220,820.00	2.90
13	601318	中国平安	1,142,722	79,967,685.56	2.86
14	601601	中国太保	1,929,914	79,937,037.88	2.86
15	300232	洲明科技	5,586,904	79,892,727.20	2.86
16	600887	伊利股份	2,362,561	76,050,838.59	2.72
17	002517	恺英网络	3,413,291	75,809,193.11	2.71
18	002334	英威腾	8,214,148	69,820,258.00	2.50
19	600519	贵州茅台	80,700	56,287,443.00	2.01
20	603589	口子窖	1,044,327	48,091,258.35	1.72
21	603600	永艺股份	2,392,596	33,998,789.16	1.22

22	601222	林洋能源	3,196,748	32,415,024.72	1.16
23	002343	慈文传媒	836,973	29,804,608.53	1.07
24	002635	安洁科技	1,122,732	29,292,077.88	1.05
25	000821	京山轻机	2,156,849	26,874,338.54	0.96
26	600197	伊力特	1,140,600	26,712,852.00	0.96
27	000799	酒鬼酒	971,479	26,637,954.18	0.95
28	002624	完美世界	766,613	25,650,870.98	0.92
29	002036	联创电子	1,364,341	22,143,254.43	0.79
30	002831	裕同科技	387,870	21,674,175.60	0.77
31	603959	百利科技	579,506	17,953,095.88	0.64
32	002078	太阳纸业	1,650,824	15,319,646.72	0.55
33	002640	跨境通	774,135	14,816,943.90	0.53
34	300013	新宁物流	1,132,010	14,659,529.50	0.52
35	300408	三环集团	686,060	13,830,969.60	0.49
36	000823	超声电子	836,895	11,339,927.25	0.41
37	600563	法拉电子	202,035	10,265,398.35	0.37
38	603228	景旺电子	187,450	10,079,186.50	0.36
39	603517	绝味食品	255,574	10,074,727.08	0.36
40	000848	承德露露	770,300	7,287,038.00	0.26
41	600559	老白干酒	222,100	6,878,437.00	0.25
42	002174	游族网络	226,800	5,057,640.00	0.18
43	601996	丰林集团	919,700	4,451,348.00	0.16
44	600258	首旅酒店	104,200	2,812,358.00	0.10
45	603808	歌力思	122,167	2,809,841.00	0.10
46	603839	安正时尚	113,884	2,790,158.00	0.10
47	603027	千禾味业	66,419	1,194,877.81	0.04
48	000888	峨眉山 A	888	9,563.76	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	267,447,540.28	1,229.47
2	000858	五粮液	246,048,958.00	1,131.10
3	002202	金风科技	213,198,167.10	980.08
4	600809	山西汾酒	199,995,557.91	919.39

5	000568	泸州老窖	177,569,367.65	816.29
6	002304	洋河股份	163,223,714.83	750.35
7	300274	阳光电源	154,748,601.28	711.39
8	002466	天齐锂业	140,038,395.89	643.76
9	600519	贵州茅台	131,768,778.53	605.75
10	601225	陕西煤业	129,327,560.84	594.52
11	002027	分众传媒	128,084,201.41	588.81
12	600702	沱牌舍得	119,088,640.45	547.45
13	002241	歌尔股份	115,391,577.40	530.46
14	300323	华灿光电	114,387,112.77	525.84
15	002456	欧菲光	113,683,429.53	522.61
16	600196	复星医药	111,833,203.94	514.10
17	000408	藏格控股	103,685,310.66	476.65
18	002517	恺英网络	101,908,091.07	468.48
19	000725	京东方 A	98,180,468.28	451.34
20	603959	百利科技	95,148,546.00	437.40
21	600887	伊利股份	89,823,057.28	412.92
22	002036	联创电子	89,110,015.35	409.64
23	601336	新华保险	86,648,056.97	398.32
24	300232	洲明科技	83,792,195.56	385.20
25	002635	安洁科技	83,536,680.81	384.02
26	300013	新宁物流	83,219,155.54	382.56
27	601601	中国太保	82,524,103.50	379.37
28	002074	国轩高科	81,801,668.65	376.05
29	601318	中国平安	79,384,466.09	364.93
30	300115	长盈精密	78,283,771.35	359.87
31	002334	英威腾	75,833,000.25	348.61
32	600019	宝钢股份	74,463,009.20	342.31
33	603799	华友钴业	72,302,212.25	332.38
34	601328	交通银行	61,016,511.35	280.50
35	300408	三环集团	59,170,486.69	272.01
36	603589	口子窖	54,126,990.35	248.82
37	601818	光大银行	53,891,030.00	247.74
38	002460	赣锋锂业	52,936,843.06	243.35
39	000049	德赛电池	50,527,501.56	232.28
40	300214	日科化学	48,314,247.12	222.10

41	300021	大禹节水	48,176,612.70	221.47
42	002127	南极电商	47,582,882.32	218.74
43	600745	闻泰科技	47,403,488.57	217.92
44	300588	熙菱信息	47,106,379.48	216.55
45	000967	盈峰环境	46,922,810.69	215.71
46	002343	慈文传媒	45,774,706.51	210.43
47	601222	林洋能源	44,797,223.52	205.93
48	601988	中国银行	42,930,059.00	197.35
49	600197	伊力特	42,393,179.60	194.88
50	000799	酒鬼酒	41,759,139.25	191.97
51	000821	京山轻机	41,062,240.73	188.76
52	603600	永艺股份	40,411,303.29	185.77
53	002640	跨境通	39,513,231.53	181.64
54	600056	中国医药	36,054,264.22	165.74
55	002831	裕同科技	35,885,264.60	164.97
56	300307	慈星股份	35,381,900.00	162.65
57	002624	完美世界	35,323,118.05	162.38
58	002816	和科达	34,980,469.79	160.81
59	600584	长电科技	33,804,708.12	155.40
60	300088	长信科技	33,753,865.40	155.17
61	600282	南钢股份	33,299,218.54	153.08
62	600298	安琪酵母	32,669,828.57	150.18
63	300207	欣旺达	32,654,380.53	150.11
64	002449	国星光电	32,217,632.43	148.11
65	000063	中兴通讯	31,849,101.08	146.41
66	600507	方大特钢	30,549,065.27	140.44
67	002850	科达利	30,003,946.40	137.93
68	000997	新大陆	29,001,320.94	133.32
69	300476	胜宏科技	28,701,420.69	131.94
70	603228	景旺电子	28,217,342.46	129.72
71	001979	招商蛇口	28,048,549.67	128.94
72	600703	三安光电	27,936,581.56	128.43
73	601699	潞安环能	27,553,083.09	126.66
74	002078	太阳纸业	27,532,354.35	126.57
75	300219	鸿利智汇	27,277,987.94	125.40
76	300433	蓝思科技	27,219,689.82	125.13

77	600563	法拉电子	26,059,642.00	119.80
78	601666	平煤股份	26,029,335.06	119.66
79	000717	韶钢松山	25,545,255.54	117.43
80	000069	华侨城 A	25,417,582.04	116.85
81	603898	好莱客	24,617,323.15	113.17
82	000823	超声电子	24,269,035.44	111.57
83	603369	今世缘	24,221,254.44	111.35
84	600545	新疆城建	23,759,475.29	109.22
85	002245	澳洋顺昌	23,165,407.89	106.49
86	600779	水井坊	23,096,284.80	106.17
87	002009	天奇股份	22,940,108.37	105.46
88	000400	许继电气	21,528,476.60	98.97
89	600885	宏发股份	21,464,095.00	98.67
90	000591	太阳能	21,201,260.60	97.46
91	002174	游族网络	20,637,491.41	94.87
92	603008	喜临门	20,343,552.50	93.52
93	300420	五洋科技	19,932,256.00	91.63
94	300244	迪安诊断	19,930,299.18	91.62
95	300438	鹏辉能源	18,942,078.00	87.08
96	002436	兴森科技	18,923,310.37	86.99
97	002050	三花智控	18,317,078.55	84.20
98	601288	农业银行	18,078,604.00	83.11
99	600340	华夏幸福	17,121,654.00	78.71
100	600195	中牧股份	16,007,323.01	73.59
101	603801	志邦股份	14,844,796.53	68.24
102	000898	鞍钢股份	14,619,700.67	67.21
103	002384	东山精密	14,502,224.00	66.67
104	603626	科森科技	14,379,128.22	66.10
105	600491	龙元建设	14,175,441.00	65.17
106	603223	恒通股份	12,726,712.00	58.51
107	600048	保利地产	12,661,735.00	58.21
108	002138	顺络电子	12,444,132.08	57.21
109	603919	金徽酒	12,279,254.55	56.45
110	300296	利亚德	12,230,014.12	56.22
111	002682	龙洲股份	12,174,877.13	55.97
112	000761	本钢板材	12,003,393.66	55.18

113	000402	金融街	11,580,925.00	53.24
114	601088	中国神华	11,501,047.50	52.87
115	600529	山东药玻	11,379,739.82	52.31
116	600016	民生银行	11,310,261.35	51.99
117	601939	建设银行	11,270,762.00	51.81
118	000960	锡业股份	11,120,919.00	51.12
119	002555	三七互娱	10,884,528.40	50.04
120	600015	华夏银行	10,819,220.70	49.74
121	601169	北京银行	10,809,105.40	49.69
122	000739	普洛药业	10,790,604.22	49.60
123	000596	古井贡酒	10,760,462.95	49.47
124	300616	尚品宅配	9,870,236.40	45.37
125	600351	亚宝药业	9,571,784.00	44.00
126	000895	双汇发展	9,543,974.03	43.87
127	300658	延江股份	9,510,036.22	43.72
128	300113	顺网科技	9,508,832.74	43.71
129	300170	汉得信息	9,484,896.07	43.60
130	002425	凯撒文化	9,437,146.38	43.38
131	002236	大华股份	9,429,381.51	43.35
132	002098	浔兴股份	9,423,544.90	43.32
133	300568	星源材质	9,420,216.00	43.31
134	600029	南方航空	9,356,401.00	43.01
135	600297	广汇汽车	9,300,395.30	42.75
136	000756	新华制药	9,279,567.97	42.66
137	600566	济川药业	9,278,758.16	42.65
138	002739	万达电影	9,185,782.00	42.23
139	600884	杉杉股份	9,030,602.00	41.51
140	603368	柳州医药	8,811,200.60	40.51
141	002196	方正电机	8,678,618.48	39.90
142	600889	南京化纤	8,524,376.17	39.19
143	603027	千禾味业	7,973,204.05	36.65
144	000848	承德露露	7,954,301.30	36.57
145	603517	绝味食品	7,953,986.66	36.56
146	603658	安图生物	7,945,009.54	36.52
147	300145	中金环境	7,935,768.60	36.48
148	300310	宜通世纪	7,513,984.00	34.54

149	600559	老白干酒	6,951,260.00	31.96
150	002035	华帝股份	6,880,047.60	31.63
151	002061	江山化工	6,772,104.82	31.13
152	600068	葛洲坝	6,602,497.00	30.35
153	002192	融捷股份	6,411,508.00	29.47
154	601012	隆基股份	5,696,065.00	26.19
155	603337	杰克股份	5,553,502.86	25.53
156	300033	同花顺	5,479,326.29	25.19
157	600373	中文传媒	5,143,500.00	23.64
158	002480	新筑股份	4,929,404.00	22.66
159	002271	东方雨虹	4,806,185.32	22.09
160	601996	丰林集团	4,797,157.00	22.05
161	300603	立昂技术	4,678,376.00	21.51
162	002567	唐人神	4,124,079.89	18.96
163	300373	扬杰科技	3,967,993.68	18.24
164	600585	海螺水泥	3,732,795.00	17.16
165	000065	北方国际	3,700,152.70	17.01
166	600977	中国电影	3,650,549.00	16.78
167	002645	华宏科技	3,568,451.00	16.40
168	601668	中国建筑	3,567,816.00	16.40
169	300335	迪森股份	3,494,869.62	16.07
170	601186	中国铁建	3,339,796.85	15.35
171	600021	上海电力	3,166,706.00	14.56
172	002462	嘉事堂	3,137,786.25	14.42
173	600148	长春一东	3,133,099.94	14.40
174	603808	歌力思	3,097,717.11	14.24
175	000661	长春高新	3,052,164.00	14.03
176	600258	首旅酒店	2,788,387.00	12.82
177	603839	安正时尚	2,787,518.72	12.81
178	000018	神州长城	2,716,619.00	12.49
179	300258	精锻科技	2,665,709.00	12.25
180	002798	帝王洁具	2,653,109.00	12.20
181	002008	大族激光	2,582,945.00	11.87
182	002101	广东鸿图	2,420,171.80	11.13
183	600114	东睦股份	2,414,494.12	11.10
184	300271	华宇软件	2,387,332.57	10.97

185	000401	冀东水泥	2,343,231.00	10.77
186	000998	隆平高科	2,256,837.00	10.37
187	601888	中国国旅	2,188,160.00	10.06
188	300190	维尔利	2,175,194.66	10.00
189	000625	长安汽车	2,163,100.00	9.94
190	002475	立讯精密	2,162,730.20	9.94
191	600337	美克家居	2,162,161.40	9.94
192	002510	天汽模	2,140,563.00	9.84
193	600873	梅花生物	2,026,179.00	9.31
194	600535	天士力	1,995,259.56	9.17
195	600338	西藏珠峰	1,969,603.00	9.05
196	600998	九州通	1,931,680.00	8.88
197	300630	普利制药	1,889,201.00	8.68
198	300287	飞利信	1,877,063.73	8.63
199	000768	中航飞机	1,851,577.00	8.51
200	603040	新坐标	1,819,678.00	8.37
201	603979	金诚信	1,785,290.00	8.21
202	002068	黑猫股份	1,755,137.00	8.07
203	600079	人福医药	1,753,407.00	8.06
204	000333	美的集团	1,692,655.00	7.78
205	002185	华天科技	1,608,635.00	7.39
206	600567	山鹰纸业	1,600,439.09	7.36
207	601991	大唐发电	1,599,071.50	7.35
208	600886	国投电力	1,597,141.00	7.34
209	600027	华电国际	1,596,966.00	7.34
210	600011	华能国际	1,595,504.16	7.33
211	600795	国电电力	1,515,396.00	6.97
212	300197	铁汉生态	1,503,528.00	6.91
213	600028	中国石化	1,500,376.00	6.90
214	600801	华新水泥	1,423,143.00	6.54
215	002536	西泵股份	1,412,807.25	6.49
216	603816	顾家家居	1,406,869.00	6.47
217	600966	博汇纸业	1,336,861.00	6.15
218	600594	益佰制药	1,333,052.00	6.13
219	002507	涪陵榨菜	1,312,240.00	6.03
220	600109	国金证券	1,299,275.00	5.97



221	600782	新钢股份	1,257,171.00	5.78
222	600963	岳阳林纸	1,201,505.00	5.52
223	300477	合纵科技	1,195,889.10	5.50
224	000636	风华高科	1,192,747.00	5.48
225	300058	蓝色光标	1,172,936.00	5.39
226	300203	聚光科技	1,144,997.99	5.26
227	000709	河钢股份	1,101,871.00	5.07
228	300425	环能科技	1,094,295.75	5.03
229	002589	瑞康医药	1,078,182.00	4.96
230	600742	一汽富维	1,038,368.00	4.77
231	000807	云铝股份	994,999.00	4.57
232	603609	禾丰牧业	943,044.00	4.34
233	600502	安徽水利	941,251.50	4.33
234	300136	信维通信	939,984.68	4.32
235	601766	中国中车	938,855.00	4.32
236	002340	格林美	937,082.60	4.31
237	002217	合力泰	935,331.90	4.30
238	600308	华泰股份	933,603.00	4.29
239	002714	牧原股份	930,682.00	4.28
240	000801	四川九洲	925,912.00	4.26
241	600118	中国卫星	925,364.00	4.25
242	600685	中船防务	924,637.00	4.25
243	600038	中直股份	923,788.00	4.25
244	600372	中航电子	923,611.24	4.25
245	601390	中国中铁	921,239.00	4.23
246	600879	航天电子	914,562.00	4.20
247	002521	齐峰新材	912,396.00	4.19
248	002422	科伦药业	912,065.00	4.19
249	300559	佳发安泰	903,068.00	4.15
250	300235	方直科技	885,510.00	4.07
251	000100	TCL 集团	878,071.00	4.04
252	002737	葵花药业	873,826.00	4.02
253	300303	聚飞光电	872,545.00	4.01
254	601633	长城汽车	871,845.00	4.01
255	000753	漳州发展	864,763.00	3.98
256	002108	沧州明珠	842,496.00	3.87

257	000878	云南铜业	827,052.00	3.80
258	002775	文科园林	816,499.00	3.75
259	600872	中炬高新	766,725.00	3.52
260	601628	中国人寿	675,654.00	3.11
261	002043	兔宝宝	674,928.00	3.10
262	601899	紫金矿业	668,610.00	3.07
263	600881	亚泰集团	667,281.00	3.07
264	000797	中国武夷	665,508.40	3.06
265	601233	桐昆股份	664,857.00	3.06
266	600549	厦门钨业	660,975.00	3.04
267	600759	洲际油气	658,932.00	3.03
268	600201	生物股份	658,623.00	3.03
269	601155	新城控股	645,307.00	2.97
270	000786	北新建材	643,217.30	2.96
271	002611	东方精工	624,011.00	2.87
272	002376	新北洋	607,035.00	2.79
273	300068	南都电源	585,590.00	2.69
274	600104	上汽集团	555,430.00	2.55
275	600741	华域汽车	551,159.00	2.53
276	300169	天晟新材	542,924.00	2.50
277	603180	金牌厨柜	531,918.00	2.45
278	002502	骅威文化	528,761.00	2.43
279	600030	中信证券	485,640.00	2.23
280	601377	兴业证券	485,298.00	2.23
281	600837	海通证券	484,796.00	2.23
282	600099	林海股份	439,464.00	2.02

注：“买入金额”按成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000651	格力电器	183,595,252.69	843.99
2	002466	天齐锂业	145,029,041.72	666.70
3	601225	陕西煤业	127,513,690.31	586.19
4	600196	复星医药	122,859,118.78	564.79

5	002241	歌尔股份	117,922,609.71	542.09
6	000725	京东方 A	116,947,277.31	537.61
7	000408	藏格控股	109,138,503.56	501.71
8	000858	五粮液	108,596,526.18	499.22
9	600519	贵州茅台	94,264,566.03	433.34
10	603959	百利科技	94,178,471.80	432.94
11	002074	国轩高科	79,736,581.54	366.55
12	600019	宝钢股份	77,547,290.30	356.49
13	603799	华友钴业	73,158,875.23	336.31
14	000568	泸州老窖	68,818,903.87	316.36
15	300115	长盈精密	63,902,200.90	293.76
16	601328	交通银行	62,531,426.03	287.46
17	300013	新宁物流	60,582,923.33	278.50
18	002036	联创电子	57,913,438.83	266.23
19	601818	光大银行	54,592,767.00	250.96
20	002202	金风科技	53,267,154.58	244.87
21	600809	山西汾酒	52,811,071.52	242.77
22	002460	赣锋锂业	52,335,539.26	240.59
23	300588	熙菱信息	50,248,009.54	230.99
24	300021	大禹节水	49,922,344.15	229.49
25	600745	闻泰科技	48,345,811.36	222.25
26	002635	安洁科技	47,748,252.57	219.50
27	002127	南极电商	47,141,197.91	216.71
28	000049	德赛电池	45,619,567.55	209.71
29	000967	盈峰环境	43,691,827.44	200.85
30	601988	中国银行	43,083,306.84	198.06
31	002027	分众传媒	41,204,881.14	189.42
32	300408	三环集团	39,143,770.32	179.95
33	600584	长电科技	36,171,517.61	166.28
34	600056	中国医药	36,020,284.64	165.59
35	300214	日科化学	35,970,642.90	165.36
36	300088	长信科技	34,522,185.49	158.70
37	600298	安琪酵母	33,927,669.66	155.97
38	600282	南钢股份	33,906,719.51	155.87
39	300307	慈星股份	32,512,520.06	149.46
40	300207	欣旺达	32,369,590.02	148.80
41	600507	方大特钢	31,662,100.59	145.55
42	600703	三安光电	31,332,422.33	144.04

43	002517	恺英网络	30,928,886.49	142.18
44	002850	科达利	30,707,316.28	141.16
45	000063	中兴通讯	30,357,008.86	139.55
46	000997	新大陆	30,050,011.29	138.14
47	601699	潞安环能	29,904,876.31	137.47
48	002449	国星光电	29,854,944.85	137.24
49	002816	和科达	27,687,621.21	127.28
50	000717	韶钢松山	27,600,945.37	126.88
51	300476	胜宏科技	27,157,194.93	124.84
52	601666	平煤股份	27,103,168.56	124.59
53	001979	招商蛇口	26,703,217.71	122.76
54	600779	水井坊	26,670,719.42	122.61
55	002009	天奇股份	26,009,109.56	119.56
56	300433	蓝思科技	25,538,493.03	117.40
57	002245	澳洋顺昌	25,037,698.13	115.10
58	600702	沱牌舍得	24,818,592.54	114.09
59	300219	鸿利智汇	24,576,141.21	112.98
60	600545	新疆城建	23,725,417.66	109.07
61	002640	跨境通	23,524,050.95	108.14
62	000069	华侨城 A	23,321,767.07	107.21
63	603369	今世缘	23,308,605.90	107.15
64	600887	伊利股份	23,209,747.69	106.70
65	000400	许继电气	23,062,589.96	106.02
66	000591	太阳能	22,936,748.89	105.44
67	603898	好莱客	22,085,447.51	101.53
68	601222	林洋能源	21,774,018.12	100.10
69	600885	宏发股份	20,782,227.68	95.54
70	603228	景旺电子	19,855,312.18	91.28
71	603008	喜临门	19,579,185.12	90.01
72	300244	迪安诊断	18,799,451.53	86.42
73	300438	鹏辉能源	18,641,587.20	85.70
74	002436	兴森科技	18,477,998.66	84.94
75	601288	农业银行	18,143,075.84	83.40
76	002384	东山精密	17,733,230.99	81.52
77	002050	三花智控	17,611,359.84	80.96
78	300274	阳光电源	16,868,087.74	77.54
79	600197	伊力特	16,764,064.78	77.07
80	600340	华夏幸福	16,685,827.80	76.71

81	600563	法拉电子	16,685,285.91	76.70
82	000799	酒鬼酒	16,485,095.40	75.78
83	002174	游族网络	15,204,984.10	69.90
84	002343	慈文传媒	15,155,145.33	69.67
85	600195	中牧股份	14,935,736.12	68.66
86	603801	志邦股份	14,837,363.20	68.21
87	600491	龙元建设	14,625,777.10	67.24
88	002078	太阳纸业	14,356,409.92	66.00
89	300420	五洋科技	14,029,098.63	64.49
90	000898	鞍钢股份	13,862,302.32	63.73
91	002138	顺络电子	13,408,748.69	61.64
92	603919	金徽酒	13,017,143.88	59.84
93	300296	利亚德	12,950,431.56	59.53
94	603626	科森科技	12,810,415.66	58.89
95	000821	京山轻机	12,626,680.19	58.05
96	002236	大华股份	12,171,753.55	55.95
97	603223	恒通股份	12,020,976.29	55.26
98	600048	保利地产	11,994,386.00	55.14
99	000823	超声电子	11,936,016.99	54.87
100	000402	金融街	11,638,829.98	53.50
101	002682	龙洲股份	11,469,804.62	52.73
102	000596	古井贡酒	11,452,351.46	52.65
103	601088	中国神华	11,339,769.10	52.13
104	601939	建设银行	11,276,586.34	51.84
105	000761	本钢板材	11,274,054.00	51.83
106	600016	民生银行	11,272,744.59	51.82
107	600015	华夏银行	10,908,105.74	50.14
108	002624	完美世界	10,901,551.95	50.11
109	601169	北京银行	10,815,368.00	49.72
110	300616	尚品宅配	10,742,512.06	49.38
111	000960	锡业股份	10,633,812.00	48.88
112	600529	山东药玻	10,598,478.80	48.72
113	002098	浔兴股份	10,517,458.38	48.35
114	000739	普洛药业	10,462,775.27	48.10
115	002555	三七互娱	10,110,907.14	46.48
116	300568	星源材质	9,997,331.54	45.96
117	300658	延江股份	9,900,020.04	45.51
118	000895	双汇发展	9,799,120.03	45.05

119	002831	裕同科技	9,738,522.54	44.77
120	600029	南方航空	9,673,128.25	44.47
121	600351	亚宝药业	9,604,965.00	44.15
122	600566	济川药业	9,556,260.42	43.93
123	000756	新华制药	9,360,090.98	43.03
124	002739	万达电影	9,319,100.84	42.84
125	600297	广汇汽车	9,276,494.45	42.64
126	300113	顺网科技	9,089,565.00	41.79
127	600884	杉杉股份	8,931,776.78	41.06
128	002425	凯撒文化	8,889,727.98	40.87
129	300170	汉得信息	8,796,310.02	40.44
130	603027	千禾味业	8,351,960.03	38.39
131	603658	安图生物	8,348,378.70	38.38
132	002196	方正电机	8,273,230.27	38.03
133	600889	南京化纤	8,190,834.25	37.65
134	603368	柳州医药	8,175,512.40	37.58
135	300145	中金环境	7,346,834.62	33.77
136	300310	宜通世纪	7,069,557.80	32.50
137	002035	华帝股份	6,957,994.42	31.99
138	002061	江山化工	6,580,481.30	30.25
139	002192	融捷股份	6,530,997.00	30.02
140	002456	欧菲光	6,239,342.50	28.68
141	603337	杰克股份	6,098,816.74	28.04
142	600068	葛洲坝	5,771,613.75	26.53
143	601012	隆基股份	5,754,396.00	26.45
144	300232	洲明科技	5,512,111.00	25.34
145	300033	同花顺	5,418,189.00	24.91
146	002271	东方雨虹	5,312,624.24	24.42
147	002334	英威腾	5,017,073.96	23.06
148	600373	中文传媒	4,985,022.00	22.92
149	002480	新筑股份	4,795,738.00	22.05
150	002567	唐人神	4,493,411.92	20.66
151	300373	扬杰科技	4,165,258.15	19.15
152	002304	洋河股份	4,153,531.00	19.09
153	300603	立昂技术	3,994,171.72	18.36
154	600585	海螺水泥	3,860,110.12	17.75
155	002645	华宏科技	3,792,871.87	17.44
156	000065	北方国际	3,725,637.89	17.13

157	601668	中国建筑	3,397,858.00	15.62
158	600977	中国电影	3,368,171.27	15.48
159	300335	迪森股份	3,321,774.41	15.27
160	600148	长春一东	3,202,667.00	14.72
161	601186	中国铁建	3,179,719.32	14.62
162	600021	上海电力	3,055,031.00	14.04
163	000661	长春高新	3,043,868.78	13.99
164	002462	嘉事堂	3,035,052.32	13.95
165	002008	大族激光	2,739,873.00	12.60
166	300258	精锻科技	2,727,728.80	12.54
167	002101	广东鸿图	2,635,508.62	12.12
168	002798	帝王洁具	2,544,080.00	11.70
169	000018	神州长城	2,509,395.00	11.54
170	603589	口子窖	2,484,797.42	11.42
171	000401	冀东水泥	2,442,196.68	11.23
172	600114	东睦股份	2,435,723.00	11.20
173	300271	华宇软件	2,420,719.47	11.13
174	600338	西藏珠峰	2,309,900.00	10.62
175	000998	隆平高科	2,300,765.06	10.58
176	601888	中国国旅	2,267,200.00	10.42
177	002510	天汽模	2,212,781.00	10.17
178	002475	立讯精密	2,187,165.00	10.05
179	000625	长安汽车	2,172,712.00	9.99
180	600337	美克家居	2,135,582.62	9.82
181	600873	梅花生物	2,007,407.20	9.23
182	600535	天士力	1,992,185.00	9.16
183	300287	飞利信	1,976,967.00	9.09
184	600998	九州通	1,968,840.24	9.05
185	603040	新坐标	1,908,857.87	8.78
186	300190	维尔利	1,890,805.00	8.69
187	002068	黑猫股份	1,824,412.00	8.39
188	300630	普利制药	1,775,546.55	8.16
189	300197	铁汉生态	1,690,929.33	7.77
190	000768	中航飞机	1,678,752.78	7.72
191	600567	山鹰纸业	1,652,882.00	7.60
192	600079	人福医药	1,643,138.00	7.55
193	000333	美的集团	1,636,094.00	7.52
194	600801	华新水泥	1,632,571.00	7.50

195	601991	大唐发电	1,618,649.00	7.44
196	603979	金诚信	1,616,809.00	7.43
197	002185	华天科技	1,610,598.42	7.40
198	600886	国投电力	1,576,333.00	7.25
199	600011	华能国际	1,565,884.27	7.20
200	600966	博汇纸业	1,548,641.00	7.12
201	603609	禾丰牧业	1,541,669.38	7.09
202	600027	华电国际	1,487,111.79	6.84
203	600795	国电电力	1,482,290.00	6.81
204	600028	中国石化	1,474,489.75	6.78
205	603816	顾家家居	1,466,454.00	6.74
206	002536	西泵股份	1,438,860.55	6.61
207	600594	益佰制药	1,355,099.65	6.23
208	600782	新钢股份	1,330,460.00	6.12
209	002507	涪陵榨菜	1,321,254.50	6.07
210	600109	国金证券	1,285,820.00	5.91
211	300477	合纵科技	1,205,186.83	5.54
212	300231	银信科技	1,161,894.00	5.34
213	300058	蓝色光标	1,147,644.14	5.28
214	600963	岳阳林纸	1,126,285.25	5.18
215	000709	河钢股份	1,124,026.24	5.17
216	000636	风华高科	1,122,646.00	5.16
217	300203	聚光科技	1,107,991.04	5.09
218	300425	环能科技	1,102,366.04	5.07
219	002589	瑞康医药	1,089,894.00	5.01
220	002340	格林美	1,088,441.00	5.00
221	002217	合力泰	1,080,428.40	4.97
222	300136	信维通信	1,046,580.55	4.81
223	000807	云铝股份	1,002,000.00	4.61
224	600742	一汽富维	975,454.00	4.48
225	600502	安徽水利	963,585.00	4.43
226	002737	葵花药业	961,411.00	4.42
227	300303	聚飞光电	953,251.76	4.38
228	002521	齐峰新材	951,420.00	4.37
229	300235	方直科技	950,190.76	4.37
230	601766	中国中车	931,695.00	4.28
231	000100	TCL 集团	924,987.00	4.25
232	600308	华泰股份	920,202.00	4.23



233	000753	漳州发展	917,701.00	4.22
234	002714	牧原股份	914,152.00	4.20
235	002422	科伦药业	912,875.00	4.20
236	300559	佳发安泰	911,023.00	4.19
237	002108	沧州明珠	910,507.00	4.19
238	601390	中国中铁	899,701.00	4.14
239	601633	长城汽车	883,847.00	4.06
240	002775	文科园林	864,827.00	3.98
241	600118	中国卫星	848,745.00	3.90
242	600879	航天电子	837,837.00	3.85
243	600685	中船防务	837,534.00	3.85
244	600038	中直股份	835,767.00	3.84
245	000878	云南铜业	835,263.00	3.84
246	600372	中航电子	810,591.52	3.73
247	600872	中炬高新	807,691.00	3.71
248	000801	四川九洲	709,510.00	3.26
249	601155	新城控股	706,837.10	3.25
250	000786	北新建材	678,344.50	3.12
251	601899	紫金矿业	676,362.00	3.11
252	002043	兔宝宝	676,347.00	3.11
253	601233	桐昆股份	675,176.00	3.10
254	600881	亚泰集团	668,777.00	3.07
255	601601	中国太保	667,185.00	3.07
256	002091	江苏国泰	665,352.50	3.06
257	600201	生物股份	661,932.00	3.04
258	600759	洲际油气	661,780.00	3.04
259	601628	中国人寿	658,790.00	3.03
260	002611	东方精工	657,337.48	3.02
261	600549	厦门钨业	652,202.00	3.00
262	000797	中国武夷	643,690.49	2.96
263	002376	新北洋	597,597.00	2.75
264	300068	南都电源	586,634.00	2.70
265	600104	上汽集团	551,617.00	2.54
266	600741	华域汽车	548,438.00	2.52
267	300169	天晟新材	545,489.49	2.51
268	603180	金牌厨柜	532,569.00	2.45
269	002502	骅威文化	529,579.00	2.43
270	600837	海通证券	481,145.69	2.21

271	601377	兴业证券	479,358.00	2.20
272	600030	中信证券	476,636.00	2.19
273	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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,968,360,847.55
卖出股票收入（成交）总额	4,582,846,570.39

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,940,267.16
2	应收证券清算款	6,711,177.90
3	应收股利	-
4	应收利息	79,794.53
5	应收申购款	8,261,466.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,992,705.68

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002027	分众传媒	37,307,600.00	1.33	大宗交易平台买入限售

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
39,726	53,117.38	918,275,629.66	43.52%	1,191,865,478.17	56.48%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,574,119.99	0.17%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### 9.4 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	0.47	10,001,200.12	0.47	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	0.47	10,001,200.12	0.47	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。

## § 10 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	3,128,843,026.91
减:本报告期基金总赎回份额	1,040,506,029.31
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	2,110,141,107.83

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2017 年 11 月 25 日，本基金管理人发布关于高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，封树标先生自 2017 年 11 月 23 日起不再担任本基金管理人公司副总经理职务。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，报告期内本基金应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬共计人民币 80,000.00 元。目前的审计机构首次为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
安信证券股 份有限公司	4	5,555,846,648.22	48.10%	5,174,520.11	48.10%	-
中信证券股 份有限公司	4	2,129,879,858.96	18.44%	1,983,555.11	18.44%	-
光大证券股 份有限公司	2	1,901,201,862.66	16.46%	1,770,585.47	16.46%	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	1,261,544,893.78	10.92%	1,174,878.76	10.92%	-
国信证券股 份有限公司	2	702,734,154.32	6.08%	654,455.55	6.08%	-

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
安信证券股	-	-	32,800,000.00	100.00%	-	-

份有限公司						
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						
国信证券股 份有限公司						

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司 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	《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 金管理人网站	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 管理人网站	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 管理人网站	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	四大证券报及本基 金管理人网站	2017年2月28日



	的公告》		
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代销机构开通申购、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19日
13	《银华基金管理股份有限公司关	四大证券报及本基	2017年4月20日

	于旗下部分基金持有的东方网络估值方法调整的公告》	金管理人网站	
14	《银华盛世精选灵活配置混合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	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 6 月 1 日

	并参与其优惠费率活动的公告》		
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》	证券时报及本基金经理人网站	2017年6月30日
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经理人网站	2017年6月30日
26	《银华基金管理股份有限公司2017年6月30日基金净值公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017年7月1日
27	《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7月1日
28	《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网上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7月4日
29	《关于增加联储证券有限责任公	四大证券报及本基	2017年7月10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并参与其费率优惠活动的公告》	金管理人网站	
30	《银华基金管理股份有限公司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7月13日
31	《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工商银行开通定期定额投资业务并参加其费率优惠的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年7月14日
32	《关于增加中国农业银行股份有限公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并参与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7月17日
33	《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蚂蚁基金开通申购、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7月20日
34	《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 2 季度报告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年7月21日
35	《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蚂蚁基金开通申购、赎回、定期定额	证券时报及本基金经理人网站	2017年7月21日

	投资及转换业务并参加费率优惠活动的公告》		
36	《关于增加上海银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017年7月25日
37	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式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8月5日
38	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式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8月5日
39	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在华西证券开通定期定额投资业务并参加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8月8日
40	《关于国元证券不再开通银华旗下全部基金转换业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年8月11日
41	《银华基金管理股份有限公司关于增加国元证券为银华旗下部分基金申购、赎回业务办理机构的公告》	证券时报及本基金管理人网站	2017年8月11日
42	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在国美基金参加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8月14日
43	《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信证券开通申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	证券时报及本基金管理人网站	2017年8月22日
44	《关于旗下部分基金参加上海华	四大证券报及本基	2017年8月23日

	夏财富投资管理有限公司费率优惠活动公告》	金管理人网站	
45	《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信证券（山东）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8月24日
46	《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》	本基金经理人网站	2017年8月29日
47	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告摘要》	证券时报及本基金经理人网站	2017年8月29日
48	《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信建投证券开通申购、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9月12日
49	《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河北银行开通申购、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9月19日
50	《关于增加上海挖财金融信息服务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9月20日
51	《关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金参加中信建投证券费率优惠的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2017年9月22日
52	《银华盛世精选灵活配置混合型	证券时报及本基金	2017年10月26日

	发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》	管理人网站	
53	《关于增加浙商证券、国都证券为银华盛世精选灵活配置混合发起式证券投资基金代销机构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 11 月 3 日
54	《关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任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 11 月 14 日
55	《关于增加上海利得基金销售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 11 月 20 日
56	《关于增加南京苏宁基金销售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 11 月 23 日
57	《关于增加上海万得基金销售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 11 月 29 日
58	《关于增加华泰证券股份有限公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并参与其费率优惠活动的公告》	中国证券报、证券时报及本基金经理人网站	2017 年 12 月 12 日
59	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京蛋卷基金销售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 12 月 19 日
60	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 12 月 29 日

	股份有限公司参加费率优惠活动的公告》		
61	《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“2018 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 12 月 29 日
62	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行开通旗下部分基金定期定额投资业务并参加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 12 月 29 日



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	0.47%
	2	2017/05/25-2017/06/14	0.00	134,796,537.60	0.00	134,796,537.60	6.39%
		2017/06/23-2017/07/06					
3	2017/05/22-2017/05/25	0.00	43,683,934.18	17,683,934.18	26,000,000.00	1.23%	
个人	1	2017/01/01-2017/04/10	7,589,857.27	5,075,025.90	12,664,883.17	0.00	0.00%

#### 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《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》
- 13.1.3 《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》
- 13.1.4 《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》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2018 年 3 月 30 日