

# 银华心诚灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华心诚灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华心诚灵活配置混合
基金主代码	005543
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 12 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,596,160,414.42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在符合国家政策导向的行业中，通过积极精选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，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>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；根据国家政治经济政策精神，确定可投资的行业范围。本基金为混合型基金，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，适当进行短期的战术避险选择。</p> <p>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%，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%。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；权证投资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，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将港股投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率*35%+中证 800 指数收益率*35%+中证综合债券指数收益率*30%。
风险收益特征	<p>本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金将投资香港联合交易所上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场风险。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010)58163000	(010)66105798
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95588
传真		(010)58163027	(010)66105799
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 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(2018年3月12日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-57,039,351.41
本期利润	-326,833,194.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1218
本期加权平均净值利润率	-12.89%
本期基金份额净值增长率	-12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-319,263,938.69
期末可供分配基金份额利润	-0.1230
期末基金资产净值	2,276,896,475.73
期末基金份额净值	0.8770
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-12.30%

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。

4、本基金合同生效日为2018年3月12日，本报告期主要财务指标的计算期间为2018年3月12日(基金合同生效日)至2018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	-6.91%	1.60%	-4.41%	0.85%	-2.50%	0.75%
过去三个月	-7.15%	1.38%	-4.69%	0.76%	-2.46%	0.62%
自基金合同生效起至今	-12.30%	1.29%	-6.85%	0.76%	-5.45%	0.53%

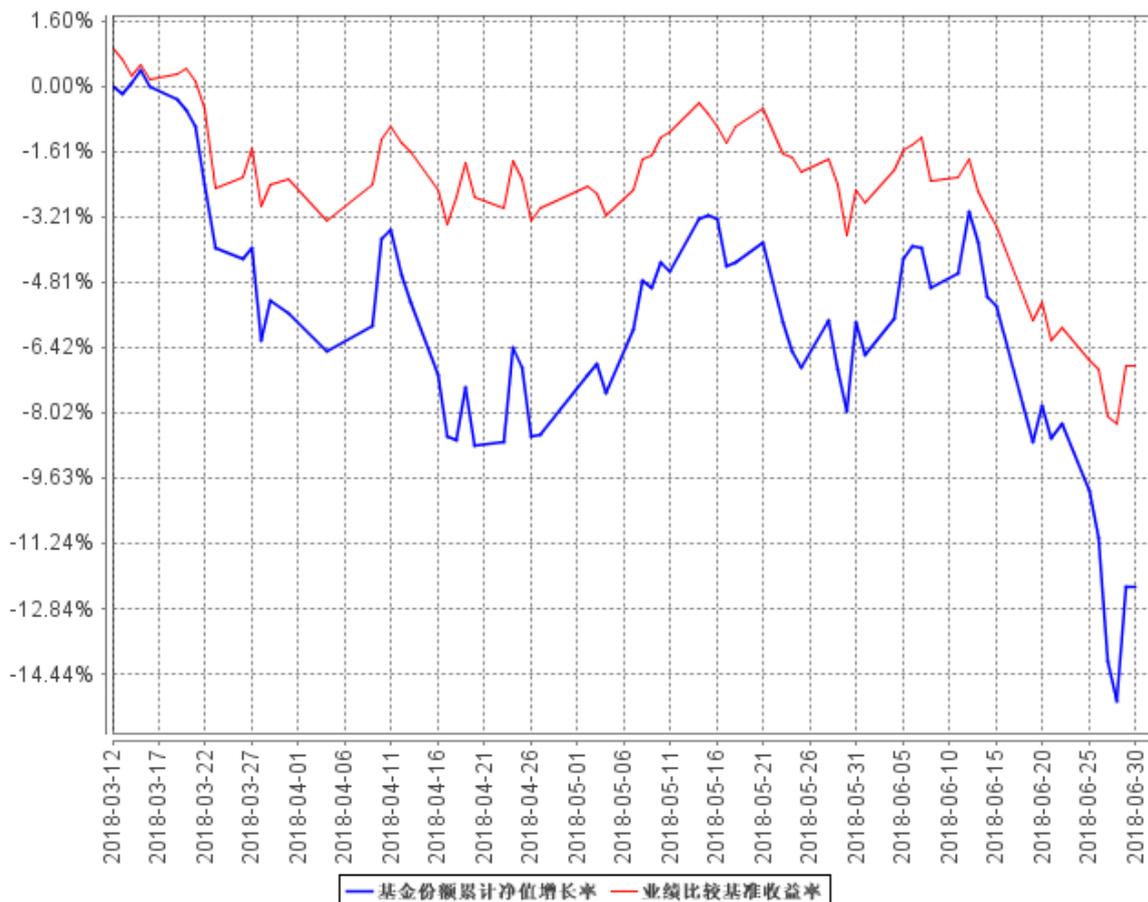
注：本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益率\*35%+中证800指数收益率\*35%+中证综合债券指数收益率\*30%。

本基金为混合型基金，因此以恒生指数收益率\*35%+中证800指数收益率\*35%+中证综合债券指数

收益率\*30%作为本基金的业绩比较基准能够比较准确地体现本基金的投资目标。

### 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 2018 年 3 月 12 日，自基金合同生效日起到报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

## §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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 100 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型发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、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、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革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		
李晓星先生	本基金的基金经理	2018年3月12日	-	6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3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2016年12月22日起担任银华盛世精选灵活配置混合型发起式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7月5日起兼任银华心怡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。
杜宇先生	本基金的基金经理助理	2018年6月18日	-	3年	硕士学位，曾就职于中国国际金融股份有限公司，2015年8月入职银华基金，历任研究部行业研究员，现任基金经理助理、TMT组组长。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基

金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

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

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

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场总体走弱。板块方面,消费、医药股表现居前,科技、周期、金融股则表现较弱。消费各细分行业保持高景气,叠加年初以来市场对中美贸易战风险上升对科技板块的担心,触发了消费和成长板块的分化行情。此外在去杠杆大背景下,现金流好的核心资产受市场追捧,而与政府资本开支相关度较高的个股出现回调。在对经济基本面保持乐观的情况下,我们保持高仓位,配置相对均衡,兼顾消费及成长,精选高景气行业中高增长的个股,取得了不错的回报。目前我们的仓位主要配置在新能源、高端制造、电子、传媒、生物医药、食品饮料等行业。

#### 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 0.8770 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.30%，业绩比较基准收益率为-6.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为政策和基本面都将趋于平稳。市场在经历上半年调整后，预计下半年将会呈现震荡向上的格局。央行货币政策委员会 6 月底例会提出保持流动性合理充裕，我们认为时间越往后推移，受益流动性放松的创业板优质标的会表现的越好。未来一段时间我们的选股主线会围绕消费升级和科技创新，自下而上的选择个股为主。部分公司已经发布了中报业绩预告，我们将重点配置半年报高增长、下半年业绩有望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新能源、高端制造、电子、传媒、计算机、生物医药、以及受益于消费升级的大众消费品等领域。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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华心诚灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，银华心诚灵活配置混合型证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华心诚灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，银华心诚灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华心诚灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：银华心诚灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	228,403,656.41
结算备付金		1,259,116.87
存出保证金		441,236.92
交易性金融资产	6.4.7.2	2,061,047,386.11
其中：股票投资		2,061,047,386.11
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		2.59
应收利息	6.4.7.5	48,189.85
应收股利		7,599,034.22
应收申购款		337,423.29
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,299,136,046.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		159.96
应付赎回款		17,660,678.90
应付管理人报酬		3,049,264.07
应付托管费		508,210.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	932,083.92
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	89,173.02
负债合计		22,239,570.53
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	2,596,160,414.42
未分配利润	6.4.7.10	-319,263,938.69
所有者权益合计		2,276,896,475.73
负债和所有者权益总计		2,299,136,046.26

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8770 元，基金份额总额

2,596,160,414.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华心诚灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 12 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 3 月 12 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-309,038,140.32
1.利息收入		1,346,051.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,346,051.97
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-40,838,318.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-65,775,084.20
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	24,936,765.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-269,793,842.63
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	247,969.18
<b>减：二、费用</b>		17,795,053.72

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,437,247.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,906,207.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,384,668.23
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	66,930.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-326,833,194.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-326,833,194.04

注：本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华心诚灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 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）	2,693,092,287.18	-	2,693,092,287.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-326,833,194.04	-326,833,194.04
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）	-96,931,872.76	7,569,255.35	-89,362,617.41
其中：1.基金申购款	9,837,288.37	-726,434.45	9,110,853.92
2.基金赎回款	-106,769,161.13	8,295,689.80	-98,473,471.33
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	2,596,160,414.42	-319,263,938.69	2,276,896,475.73

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王立新	_____ 凌宇翔	_____ 伍军辉
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

银华心诚灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017] 2362 号《关于准予银华心诚灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于 2018 年 3 月 5 日至 2018 年 3 月 6 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2018）验字第 60468687\_A03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2018 年 3 月 12 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时银华心诚灵活配置混合已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 2,692,996,324.78 元，折合 2,692,996,324.78 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 95,962.40 元，折合 95,962.40 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 2,693,092,287.18 元，折合 2,693,092,287.18 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围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）、港股通标的股票、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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。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%，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%。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；权证投资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，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将港股投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。业绩比较基准：恒生指数收益率\*35%+中证 800 指数收益率\*35%+中证综合债券指数收益率\*30%。

## 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于 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 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 2018 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2018 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；

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，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产

或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 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**

无。

### **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**

无。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增

值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所

得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	228,403,656.41
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	228,403,656.41

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,330,841,228.74	2,061,047,386.11	-269,793,842.63
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	2,330,841,228.74	2,061,047,386.11	-269,793,842.63

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	47,424.65
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	566.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	198.60
合计	48,189.85

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	932,083.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	932,083.92

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	44,020.44
预提费用	45,152.58
合计	89,173.02

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,693,092,287.18	2,693,092,287.18
本期申购	9,837,288.37	9,837,288.37
本期赎回(以“-”号填列)	-106,769,161.13	-106,769,161.13
- 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	2,596,160,414.42	2,596,160,414.42

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2018年3月5日至2018年3月6日向社会公开募集，截至2018年3月12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2,692,996,324.78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95,962.40元，以上收到的实收资金合计人民币2,693,092,287.18元，折算成基金份额计2,693,092,287.18份基金份额。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-57,039,351.41	-269,793,842.63	-326,833,194.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,925,018.20	5,644,237.15	7,569,255.35
其中：基金申购款	-197,634.42	-528,800.03	-726,434.45
基金赎回款	2,122,652.62	6,173,037.18	8,295,689.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-55,114,333.21	-264,149,605.48	-319,263,938.69

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 12 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,265,652.14
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	78,071.93
其他	2,327.90
合计	1,346,051.97

#### 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 2018 年 3 月 12 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	360,477,099.14
减：卖出股票成本总额	426,252,183.34
买卖股票差价收入	-65,775,084.20

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 12 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
----	--

股票投资产生的股利收益	24,936,765.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	24,936,765.36

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-269,793,842.63
——股票投资	-269,793,842.63
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-269,793,842.63

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
基金赎回费收入	246,969.12
转换费收入	983.82
其他	16.24
合计	247,969.18

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
交易所市场交易费用	4,384,668.23

银行间市场交易费用	-
合计	4,384,668.23

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
审计费用	22,576.29
信息披露费	22,576.29
证券组合费_港股通	289.88
证券组合费_港股通_深圳	19,804.88
银行费用	1,682.70
合计	66,930.04

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

无。

#### 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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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 本报告期的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
-------	--------------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券	135,956,080.93	4.36%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	99,425.66	3.78%	99,425.66	10.67%

#### 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 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,437,247.55
其中：支付销售机构的客户维护费	5,740,181.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费		1,906,207.90

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西南证券股份有限公司	5,999,240.00	0.23%

**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 2018年3月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	228,403,656.41	1,265,652.14

#### 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：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

注：无。

#### 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。

### 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。

#### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

### 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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	228,403,656.41	-	-	-	-	-	228,403,656.41
结算备付金	1,259,116.87	-	-	-	-	-	1,259,116.87
存出保证金	441,236.92	-	-	-	-	-	441,236.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,061,047,386.11	2,061,047,386.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2.59	2.59
应收利息	-	-	-	-	-	48,189.85	48,189.85
应收股利	-	-	-	-	-	7,599,034.22	7,599,034.22
应收申购款	4,000.00	-	-	-	-	333,423.29	337,423.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	230,108,010.20	-	-	-	-	-2,069,028,036.06	2,299,136,046.26
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	159.96	159.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,660,678.90	17,660,678.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,049,264.07	3,049,264.07
应付托管费	-	-	-	-	-	508,210.66	508,210.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	932,083.92	932,083.92
其他负债	-	-	-	-	-	89,173.02	89,173.02
负债总计	-	-	-	-	-	22,239,570.53	22,239,570.53
利率敏感度缺口	230,108,010.20	-	-	-	-	-2,046,788,465.53	2,276,896,475.73
上年度末 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							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金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。

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	760,138,829.36		760,138,829.36
资产合计	-	760,138,829.36		760,138,829.36
以外币计价的负债	-			
负债合计	-			
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	760,138,829.36		760,138,829.36

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变	
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动	
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（2018年6月30日）
	港币 5%	38,006,941.47
	港币 -5%	-38,006,941.47

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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	2,061,047,386.11	90.52	-	-
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	2,061,047,386.11	90.52	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 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。		
	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（2018年 6月30日）	上年度末（2017年 12月31日）
分析	+5%	169,929,620.75	-
	-5%	-169,929,620.75	-

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## §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	2,061,047,386.11	89.64
	其中：股票	2,061,047,386.11	89.64
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	229,662,773.28	9.99
8	其他各项资产	8,425,886.87	0.37
9	合计	2,299,136,046.26	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	23,261,120.00	1.02
C	制造业	913,854,871.89	40.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	-	-

	务业		
J	金融业	69,382,152.00	3.05
K	房地产业	131,018,361.26	5.75
L	租赁和商务服务业	163,384,246.08	7.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,805.52	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,300,908,556.75	57.14

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	66,434,593.80	2.92
B 消费者非必需品	33,971,407.70	1.49
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	423,281,352.24	18.59
F 医疗保健	-	-
G 工业	218,521,267.92	9.60
H 信息技术	17,930,207.70	0.79
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	760,138,829.36	33.38

### 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	002027	分众传媒	17,072,544	163,384,246.08	7.18
2	02208	金风科技	11,981,600	96,471,110.47	4.24
2	002202	金风科技	3,590,462	45,383,439.68	1.99
3	000651	格力电器	2,161,500	101,914,725.00	4.48
4	000858	五粮液	1,319,651	100,293,476.00	4.40
5	00388	香港交易所	465,100	92,541,691.16	4.06

6	600519	贵州茅台	112,370	82,194,160.20	3.61
7	600887	伊利股份	2,931,880	81,799,452.00	3.59
8	600196	复星医药	1,884,900	78,016,011.00	3.43
9	601318	中国平安	1,184,400	69,382,152.00	3.05
10	02899	紫金矿业	26,266,000	66,434,593.80	2.92
11	03328	交通银行	10,476,000	53,082,216.76	2.33
12	03988	中国银行	15,214,000	49,896,732.03	2.19
13	00939	建设银行	7,860,000	48,044,053.50	2.11
14	03968	招商银行	1,941,500	47,387,636.92	2.08
15	603589	口子窖	754,613	46,370,968.85	2.04
16	002466	天齐锂业	926,632	45,951,680.88	2.02
17	00670	中国东方航空股份	10,242,000	45,852,010.36	2.01
18	00966	中国太平	2,205,200	45,643,461.15	2.00
19	01288	农业银行	14,407,000	44,577,808.04	1.96
20	02601	中国太保	1,645,600	42,107,752.68	1.85
21	00753	中国国航	6,074,000	38,817,099.66	1.70
22	01055	中国南方航空股份	7,186,000	37,381,047.43	1.64
23	300323	华灿光电	2,530,276	32,691,165.92	1.44
24	002304	洋河股份	239,800	31,557,680.00	1.39
25	600585	海螺水泥	793,615	26,570,230.20	1.17
26	000425	徐工机械	6,238,500	26,451,240.00	1.16
27	000786	北新建材	1,377,368	25,522,629.04	1.12
28	600702	舍得酒业	688,900	24,862,401.00	1.09
29	000333	美的集团	463,400	24,198,748.00	1.06
30	002271	东方雨虹	1,392,292	23,682,886.92	1.04
31	601155	新城控股	759,200	23,512,424.00	1.03
32	001979	招商蛇口	1,229,700	23,425,785.00	1.03
33	601699	潞安环能	2,512,000	23,261,120.00	1.02
34	002456	欧菲科技	1,415,300	22,828,789.00	1.00
35	600048	保利地产	1,845,600	22,516,320.00	0.99
36	000069	华侨城 A	3,073,362	22,220,407.26	0.98
37	002236	大华股份	963,914	21,736,260.70	0.95
38	600703	三安光电	1,129,100	21,701,302.00	0.95
39	00868	信义玻璃	2,610,000	21,102,708.69	0.93
40	000002	万科 A	824,000	20,270,400.00	0.89
41	600176	中国巨石	1,981,250	20,268,187.50	0.89
42	600340	华夏幸福	740,700	19,073,025.00	0.84

43	00981	中芯国际	2,085,000	17,930,207.70	0.79
44	01211	比亚迪股份	321,000	12,868,699.01	0.57
45	002078	太阳纸业	1,175,800	11,393,502.00	0.50
46	600567	山鹰纸业	2,882,300	11,125,678.00	0.49
47	002572	索菲亚	228,100	7,340,258.00	0.32
48	000888	峨眉山 A	888	7,805.52	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	176,699,173.83	7.76
2	02208	金风科技	132,689,481.73	5.83
3	600887	伊利股份	119,610,696.16	5.25
4	00700	腾讯控股	115,069,670.67	5.05
5	000858	五粮液	110,216,244.32	4.84
6	00388	香港交易所	104,869,818.57	4.61
7	000651	格力电器	102,191,061.45	4.49
8	000725	京东方 A	90,531,091.38	3.98
9	601318	中国平安	84,202,459.70	3.70
10	600519	贵州茅台	80,707,344.30	3.54
11	02899	紫金矿业	79,984,088.00	3.51
12	600196	复星医药	76,909,887.50	3.38
13	002202	金风科技	57,525,036.57	2.53
14	00966	中国太平	53,849,060.02	2.37
15	02601	中国太保	53,845,589.26	2.36
16	03988	中国银行	53,443,056.97	2.35
17	01288	农业银行	53,439,799.52	2.35
18	03328	交通银行	53,434,493.85	2.35
19	00939	建设银行	53,431,942.04	2.35
20	03968	招商银行	53,407,878.98	2.35
21	00670	中国东方航空股份	51,089,052.95	2.24
22	300274	阳光电源	50,653,121.39	2.22
23	300323	华灿光电	50,644,789.84	2.22
24	002466	天齐锂业	49,999,808.70	2.20

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	110,252,095.03	4.84
2	000725	京东方 A	70,283,220.89	3.09
3	300274	阳光电源	45,607,145.26	2.00
4	600887	伊利股份	24,968,986.25	1.10
5	600019	宝钢股份	24,356,355.12	1.07
6	601225	陕西煤业	23,867,741.85	1.05
7	600282	南钢股份	23,265,263.58	1.02
8	00763	中兴通讯	22,495,015.60	0.99
9	000858	五粮液	12,815,095.16	0.56
10	300323	华灿光电	2,566,065.20	0.11
11	000888	峨眉山 A	115.20	0.00

注：1、本基金本报告期仅卖出上述股票。

2、“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,757,093,412.08
卖出股票收入（成交）总额	360,477,099.14

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	441,236.92
2	应收证券清算款	2.59
3	应收股利	7,599,034.22
4	应收利息	48,189.85
5	应收申购款	337,423.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,425,886.87

### 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情况的说明。

### 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
41,587	62,427.21	27,255,122.68	1.05%	2,568,905,291.74	98.95%

### 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	1,261,116.31	0.05%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年3月12日）基金份额总额	2,693,092,287.18
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,837,288.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	106,769,161.13
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,596,160,414.42

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

本基金管理人于 2018 年 6 月 23 日发布关于副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，苏薪茗先生自 2018 年 6 月 21 日起担任本基金管理人副总经理职务。

#### 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

本基金由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)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	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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
长江证券股份有限公司		21,224,841,872.30	39.29%	978,159.09	37.17%	—
中信证券股份有限公司	1	488,601,401.93	15.67%	455,034.18	17.29%	—
东吴证券股份有限公司	2	409,296,518.56	13.13%	299,319.20	11.37%	—
兴业证券股份有限公司	1	402,418,663.96	12.91%	374,771.76	14.24%	—
方正证券股份有限公司	2	226,129,101.11	7.25%	210,594.60	8.00%	—
国海证券股份有限公司	2	154,346,307.32	4.95%	143,741.99	5.46%	—
东北证券股份有限公司	2	135,956,080.93	4.36%	99,425.66	3.78%	—
莫尼塔投资发展有限公司	2	75,980,565.11	2.44%	70,760.32	2.69%	—
国泰君安证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
国联证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
英大证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
国盛证券有限责任公司	2	—	—	—	—	—
长城证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
国信证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
安信证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
爱建证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
光大证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
西藏同信证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
中国国际金融有限公司	2	—	—	—	—	—
招商证券股	1	—	—	—	—	—

份有限公司						
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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

3、本基金合同生效日为 2018 年 3 月 12 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

### 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
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
莫尼塔投资 发展有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财	-	-	-	-	-	-

富证券股份 有限公司						
西部证券股 份有限公司						
中国中投证 券有限责任 公司						
中泰证券股 份有限公司						
天风证券股 份有限公司						
瑞银证券有 限责任公司						

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券、债券回购、权证交易。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华心诚灵活配置混合型证券投资 基金招募说明书》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
2	《银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金托管协议》	本基金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
3	《银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金基金合同摘要》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
4	《银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金基金合同》	本基金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
5	《银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金基金份额发售公告》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
6	《关于银华心诚灵活配置混合型 证券投资基金网上直销认购费率 优惠活动的公告》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 14 日
7	《银华基金管理股份有限公司关 于银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金和银华积极成长混合型 证券投资基金参加部分代销机构 认购费率优惠活动的公告》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 23 日
8	《银华基金管理股份有限公司关 于增加部分代销机构为银华心诚 灵活配置混合型证券投资基金代 销机构并参加部分代销机构认 购费率优惠活动的公告》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 2 月 28 日
9	《银华基金管理股份有限公司关 于银华心诚灵活配置混合型证券 投资基金提前结束募集时间的公 告》	证券日报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 7 日

10	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为银华积极成长混合型证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告》	证券日报、上海证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 7 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 13 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的中兴通讯估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 4 月 20 日
13	《关于网上直销开通中国农业银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 5 月 3 日
14	《银华心诚灵活配置混合型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》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 7 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于银华心诚灵活配置混合型证券投资基金参加代销机构费率优惠活动的公告》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 8 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于银华心诚灵活配置混合型证券投资基金在部分代销机构参与费率优惠活动的公告》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 9 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 11 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的天齐锂业、永清环保、楚江新材估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
19	《银华心诚灵活配置混合型证券投资基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 27 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于银华心诚灵活配置混合型证券投资基金在大同证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告》	证券日报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 28 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京格上富信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日

	并参加其费率优惠活动的公告》		
22	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行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	2018 年 6 月 30 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 本基金管理人于 2018 年 6 月 7 日发布了《银华心诚灵活配置混合型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》，本基金于 2018 年 6 月 11 日首次开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务。

2. 本基金管理人于 2018 年 6 月 11 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》，自 2018 年 6 月 12 日起调整本基金定期定额投资的最低金额为 10 元。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华心诚灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华心诚灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华心诚灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2018年8月28日