

银华优势企业证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 35 |
| 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..... | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 41 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 41 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 41 |
| §8 基金份额持有人信息 | 42 |

| | |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 42 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 43 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 43 |
| §10 重大事件揭示..... | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 43 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 10.8 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| §12 备查文件目录..... | 51 |
| 12.1 备查文件目录..... | 51 |
| 12.2 存放地点..... | 51 |
| 12.3 查阅方式..... | 52 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 银华优势企业证券投资基金 |
| 基金简称 | 银华优势企业混合 |
| 基金主代码 | 180001 |
| 前端交易代码 | 180001 |
| 后端交易代码 | 180011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2002 年 11 月 13 日 |
| 基金管理人 | 银华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 874,646,525.30 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金为平衡型基金，主要通过投资于中国加入 WTO 后具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>坚持平衡原则：平衡收益与风险；平衡长期收益与短期收益；平衡股票与债券的投资；平衡成长型与价值型股票的投资。</p> <p>本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。</p> <p>基于大盘走势关系基金投资全局，本基金充分重视对各市场趋势尤其是对股市大盘趋势的研判，并因此将控制基金仓位放在资产配置和投资组合中的优先位置。本基金资产配置采取自上而下的操作流程，而股票选择采取自下而上的操作流程。</p> |
| 业绩比较基准 | 标普中国 A 股 300 指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%。 |
| 风险收益特征 | 注重收益与风险的平衡，通过控制股票、债券的投资比重来获取中低风险下的中等收益。 |

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 | 银华基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨文辉 |
| | 联系电话 | (010)58163000 |
| | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4006783333, (010)85186558 | 95566 |
| 传真 | (010)58163027 | (010) 66594942 |
| 注册地址 | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 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 | 北京西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | 100738 | 100818 |
| 法定代表人 | 王珠林 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.yhfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -47,162,597.67 |
| 本期利润 | -283,243,173.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3263 |
| 本期加权平均净值利润率 | -24.06% |
| 本期基金份额净值增长率 | -19.05% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 282,011,062.15 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3224 |

| | |
|---------------------|-------------------------|
| 期末基金资产净值 | 1,156,657,587.45 |
| 期末基金份额净值 | 1.3224 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 465.70% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

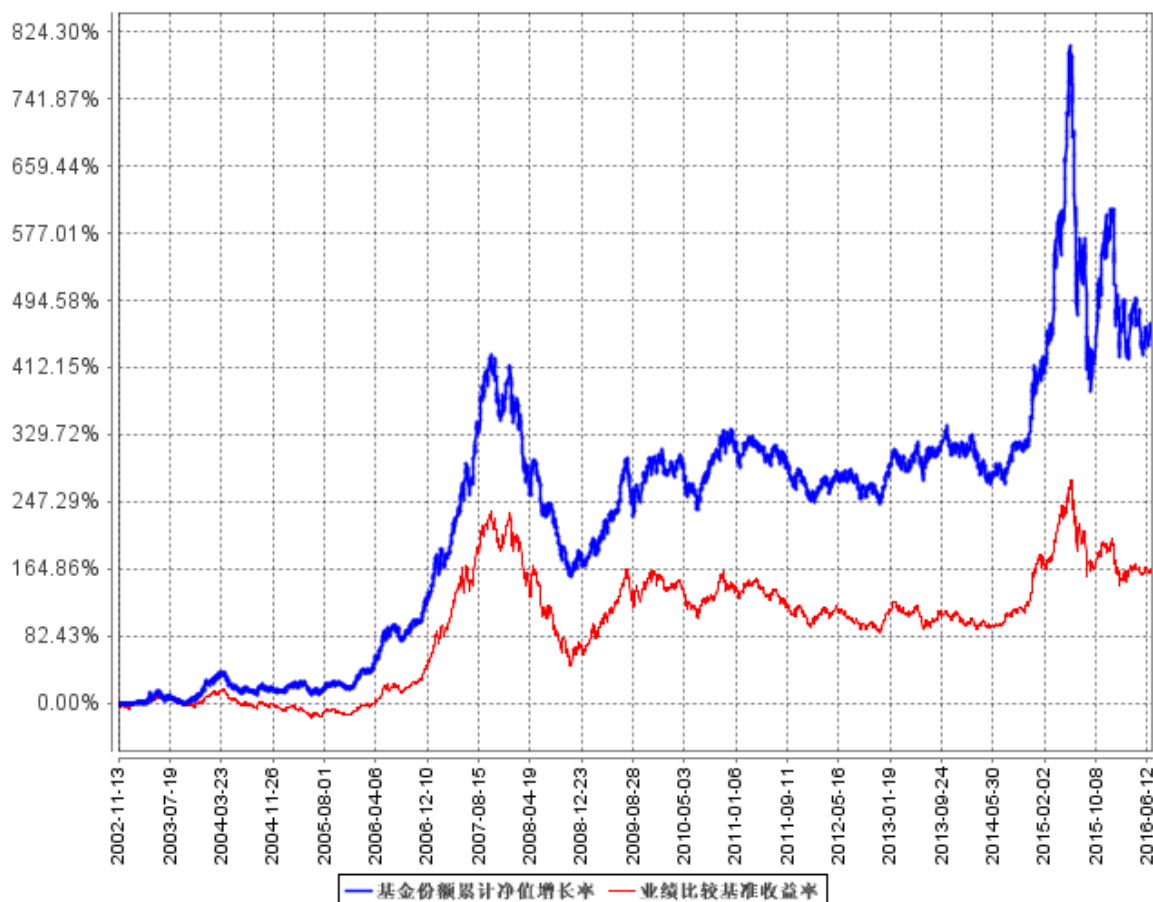
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 2.08% | 1.12% | -0.11% | 0.64% | 2.19% | 0.48% |
| 过去三个月 | -3.24% | 1.36% | -0.90% | 0.67% | -2.34% | 0.69% |
| 过去六个月 | -19.05% | 2.00% | -10.16% | 1.24% | -8.89% | 0.76% |
| 过去一年 | -20.07% | 2.27% | -19.76% | 1.56% | -0.31% | 0.71% |
| 过去三年 | 47.75% | 1.71% | 36.25% | 1.26% | 11.50% | 0.45% |
| 自基金合同生效起至今 | 465.70% | 1.28% | 164.70% | 1.24% | 301.00% | 0.04% |

注：本基金的业绩比较基准为：标普中国 A 股 300 指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%。标普中国 A 股 300 指数包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大、最具流动性的 300 只股票并以流通股本加权的股票指数，是目前中国证券市场中与本基金股票投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数。

本基金的股票投资比例范围为：20-70%，所以本基金加入 20%的上证国债指数和 10%的同业活期存款利率一起构成本基金的业绩比较基准。

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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理

及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 50 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、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、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、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和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。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-------|----------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王鑫钢先生 | 本基金的基金经理 | 2013 年 2 月 7 日 | - | 7 年 | 硕士学位。2008 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任行业研究员、行业研究组长及基金经理 |

| | | | | | |
|-------|-----------|----------------|---|-----|--|
| | | | | | 助理职务。自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 1 日起兼任银华鑫锐定增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。 |
| 王利刚先生 | 本基金基金经理助理 | 2016 年 2 月 1 日 | - | 4 年 | 硕士学位。2012 年加盟银华基金管理有限公司，历任计算机行业研究员、传媒行业研究员，现任投资一部基金经理助理。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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

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、《银华优势企业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。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，上半年 GDP 同比增长 6.7%，规模以上工业增加值同比增长 6.0%，固定资产投资同比增长 9.0%，社会消费品零售总额同比增长 10.3%。上半年投资增速回落，制造业投资和民间投资持续下行，基建投资增速维持高位，是支撑固定资产投资的主要动力。在全球经济不振的大背景下，出口持续负增长。消费增速稳中有升，对经济增长的拉动作用增强，经济结构调整的效果持续显现。总体而言，上半年宏观经济总体运行平稳，经济结构稳步改善，宏观经济政策方面虽然出现了一些反复，但总体上维持了相对稳健的稳增长政策和货币政策。海外方面，美国非农就业数据时好时坏，经济复苏弱于预期，美联储 FOMC 会议决议已由鹰转鸽，当前市场对美联储加息的预期已降至年内至多加息一次。全球政治与经济格局的不稳定性加剧，风险事件频出，英国脱欧引发全球金融市场大幅动荡，全球民粹主义势力抬头与地缘政治摩擦加剧。全球经济复苏乏力，各国央行持续加码宽松的货币政策。全球资金持续流入美元、日元、黄金等相关资产以寻求避险与保值。

本基金认为，对中国股市而言，当前宏观经济走势及相关政策等内部变量保持稳定，而美联储加息预期与全球风险事件等外部变量则是中短期的核心变量。股市在经历过一轮充分的去杠杆之后，处在相对低位，相对积极的应对策略是较好选择，可以顺应外部风险累积与释放的节奏积极做一些波段操作。基于以上认识，本基金在上半年总体选择较为积极的投资策略。但是，由于年初市场对汇率风险与美联储加息的过度担忧，叠加熔断机制的放大效应，A 股市场发生了一轮暴跌，受此影响本基金在一季度前半段表现较差。在内、外部风险得以集中释放之后，三月份美联储由鹰转鸽，市场迎来一波反弹，本基金积极应对，挽回一定损失。本基金在二季度根据市场对全球风险事件的预期波动做了相应的应对策略，总体上在四月初市场大涨之后相对保守，五月

底在市场大跌后相对乐观，本基金在仓位上的控制一定程度规避了相关风险事件对业绩的影响，但本基金对新能源汽车、物联网等强势主题的配置力度不够，因此本基金在二季度业绩略有提升，但并没有太明显的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3224 元，本报告期份额净值增长率为-19.05%，同期业绩比较基准增长率为-10.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，十三五将是中国改革措施落地的密集期，也是中国经济新常态逐步形成的关键阶段，持续推进国企改革与供给侧结构性改革，短期会对经济增长带来一些压力，但长期来看对过剩产能的治理有利于经济结构的调整与转型，我们对中国经济成功转型依然充满信心。中国的改革大潮不可阻挡，在中期低利率背景下，支撑资本市场走强的基本因素并未发生根本性逆转。海外方面，美联储加息预期趋弱，而包括日本、英国、欧盟等在内的各国央行将继续加码货币宽松政策以刺激低迷的经济，全球流动性宽裕的环境依旧，有利于全球风险资产价格的修复。但英国脱欧事件对欧盟及英国内部的影响有望持续发酵、民粹主义势力抬头、地缘政治摩擦加剧，相关风险事件将是全球资本市场潜在的黑天鹅。

本基金认为，对于国内经济，不对短期走势乐观，但也不必对长期走势悲观，宏观经济总体运行平稳，经济结构稳步改善，宏观经济政策方面虽然出现了一些反复，但总体上维持了相对稳健的稳增长政策和货币政策。当前对 A 股市场影响最大的变量在于海外，英国成功脱欧引发国际金融市场大幅动荡，其对于全球政治及经济格局的巨大影响将在中长期逐步体现。但短期来看，英国脱欧使得全球资金流向避险的美元、日元与大宗商品，叠加美国国内偏弱的就业数据，美联储很有可能在年内都不会加息，各国货币宽松趋势有望持续，短期看有助于全球风险资产价格的修复，A 股从七月份开始有望迎来一个“吃饭”行情。当下本基金将以更加积极的仓位参与本阶段的行情，在优选适合中国经济未来发展方向、具有优秀管理团队的成长型公司作为核心持仓的基础上，再做一些强势主题品种的配置，以期取得较好的收益。本基金认为 A 股在中短期将维持宽幅震荡的走势，本基金在下半年将继续采取相对积极的应对策略，顺应外部风险累积与释放的节奏积极做一些波段操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2016 年 3 月 2 日发布分红公告，向于 2016 年 3 月 4 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 1.000 元，实际分配收益金额为人民币 84,536,985.86 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华优势企业证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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。

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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

§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：银华优势企业证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 65,045,002.97 | 109,495,448.33 |
| 结算备付金 | | 1,436,076.86 | 5,033,347.38 |
| 存出保证金 | | 538,535.35 | 543,117.62 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,089,306,137.67 | 1,339,083,055.28 |
| 其中：股票投资 | | 768,934,880.77 | 992,736,164.58 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 320,371,256.90 | 346,346,890.70 |
| 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 | | 94,833.03 | 31,340,387.09 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 4,821,911.47 | 5,119,571.05 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 17,647.65 | 371,612.69 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,161,260,145.00 | 1,490,986,539.44 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付赎回款 | | 1,637,040.54 | 1,617,735.52 |
| 应付管理人报酬 | | 1,401,841.18 | 1,866,495.85 |
| 应付托管费 | | 233,640.20 | 311,082.65 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,004,672.75 | 1,886,317.24 |
| 应交税费 | | 60,187.20 | 60,187.20 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 265,175.68 | 460,937.57 |
| 负债合计 | | 4,602,557.55 | 6,202,756.03 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 874,646,525.30 | 842,627,810.24 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 282,011,062.15 | 642,155,973.17 |
| 所有者权益合计 | | 1,156,657,587.45 | 1,484,783,783.41 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,161,260,145.00 | 1,490,986,539.44 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.3224 元，基金份额总额为 874,646,525.30 份。

6.2 利润表

会计主体：银华优势企业证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | -268,495,778.96 | 886,559,838.69 |
| 1.利息收入 | | 4,710,924.68 | 9,777,755.24 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 486,079.96 | 666,837.59 |
| 债券利息收入 | | 4,202,489.95 | 9,110,917.65 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 22,354.77 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -37,145,013.52 | 941,064,414.62 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -39,184,188.44 | 932,184,777.82 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 420,128.08 | 6,410,657.02 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.3 | - | - |
| 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 | 1,619,046.84 | 2,468,979.78 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-” | 6.4.7.17 | -236,080,575.35 | -64,624,432.68 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| ”号填列) | | | |
| 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 | 18,885.23 | 342,101.51 |
| 减:二、费用 | | 14,747,394.06 | 28,398,145.57 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,802,671.76 | 16,726,570.03 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,467,111.96 | 2,787,761.66 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.19 | 4,258,340.44 | 8,563,894.73 |
| 5.利息支出 | | - | 80,097.36 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | 80,097.36 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.20 | 219,269.90 | 239,821.79 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -283,243,173.02 | 858,161,693.12 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -283,243,173.02 | 858,161,693.12 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华优势企业证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | |
|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 842,627,810.24 | 642,155,973.17 | 1,484,783,783.41 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -283,243,173.02 | -283,243,173.02 |
| 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) | 32,018,715.06 | 7,635,247.86 | 39,653,962.92 |
| 其中:1.基金申购款 | 65,824,136.65 | 20,224,860.46 | 86,048,997.11 |
| 2.基金赎回款 | -33,805,421.59 | -12,589,612.60 | -46,395,034.19 |
| 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) | - | -84,536,985.86 | -84,536,985.86 |

| | | | |
|--|---------------------------------|-----------------|-------------------|
| 以“-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 874,646,525.30 | 282,011,062.15 | 1,156,657,587.45 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 1,686,258,786.42 | 471,285,584.25 | 2,157,544,370.67 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 858,161,693.12 | 858,161,693.12 |
| 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) | -731,078,002.31 | -548,665,272.24 | -1,279,743,274.55 |
| 其中:1.基金申购款 | 164,345,989.58 | 138,181,504.06 | 302,527,493.64 |
| 2.基金赎回款 | -895,423,991.89 | -686,846,776.30 | -1,582,270,768.19 |
| 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) | - | -31,240,823.66 | -31,240,823.66 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 955,180,784.11 | 749,541,181.47 | 1,704,721,965.58 |

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

基金管理人负责人

杨清

主管会计工作负责人

龚飒

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华优势企业证券投资基金(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”)证监基金字[2002]71号文《关于同意银华优势企业(平衡型)证券投资基金设立的批复》的核准,由银华基金管理有限公司依照《基金法》、基金合同及其他有关规定向社会公开发行募集。经向中国证监会备案,《银华优势企业证券投资基金基金合同》于2002年11月13日正式生效,首次设立募集规模为1,682,572,543.63份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资的标的物为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资的重点是中国入世后以及在全球经济一体化过程中具有相对竞争优势即总成本领先优势和标新立异优势的上市公司所发行的股票，这部分投资的比例不低于本基金股票资产的 80%。本基金投资组合中股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%。投资证券的资产不低于基金总资产的 80%。投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金业绩比较基准：中信标普 300 指数×70%+中信全债指数×20%+同业活期存款利率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本报告期财务报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰； 经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、国家税务总局财税字[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。

2. 营业税、企业所得税

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

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由

上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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《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。

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 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 65,045,002.97 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 65,045,002.97 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 770,434,532.62 | 768,934,880.77 | -1,499,651.85 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 110,148,944.28 | 110,655,256.90 | 506,312.62 |
| | 银行间市场 | 209,593,500.00 | 209,716,000.00 | 122,500.00 |

| | | | | |
|--------|----|------------------|------------------|-------------|
| | 合计 | 319,742,444.28 | 320,371,256.90 | 628,812.62 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| | 合计 | 1,090,176,976.90 | 1,089,306,137.67 | -870,839.23 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易债券余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 15,326.06 |
| 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 | 582.48 |
| 应收债券利息 | 4,805,743.41 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 41.45 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 218.07 |
| 合计 | 4,821,911.47 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,004,472.75 |

| | |
|-------------|--------------|
| 银行间市场应付交易费用 | 200.00 |
| 合计 | 1,004,672.75 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,736.69 |
| 预提费用 | 193,931.92 |
| 其他 | 69,507.07 |
| 合计 | 265,175.68 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 842,627,810.24 | 842,627,810.24 |
| 本期申购 | 65,824,136.65 | 65,824,136.65 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -33,805,421.59 | -33,805,421.59 |
| - 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 | 874,646,525.30 | 874,646,525.30 |

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 816,896,094.16 | -174,740,120.99 | 642,155,973.17 |
| 本期利润 | -47,162,597.67 | -236,080,575.35 | -283,243,173.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 26,472,593.41 | -18,837,345.55 | 7,635,247.86 |
| 其中：基金申购款 | 55,955,507.69 | -35,730,647.23 | 20,224,860.46 |
| 基金赎回款 | -29,482,914.28 | 16,893,301.68 | -12,589,612.60 |
| 本期已分配利润 | -84,536,985.86 | - | -84,536,985.86 |
| 本期末 | 711,669,104.04 | -429,658,041.89 | 282,011,062.15 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 457,965.56 |
| 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 | 22,480.55 |
| 其他 | 5,633.85 |
| 合计 | 486,079.96 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,393,761,427.82 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,432,945,616.26 |
| 买卖股票差价收入 | -39,184,188.44 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 420,128.08 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 420,128.08 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

| | |
|-------------------------|----------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 284,757,191.73 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 279,420,789.52 |
| 减：应收利息总额 | 4,916,274.13 |
| 买卖债券差价收入 | 420,128.08 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,619,046.84 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,619,046.84 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -236,080,575.35 |
| ——股票投资 | -236,022,154.47 |
| ——债券投资 | -58,420.88 |
| ——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 | -236,080,575.35 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 16,967.74 |
| 转换费收入 | 1,917.49 |
| 合计 | 18,885.23 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 4,257,940.44 |
| 银行间市场交易费用 | 400.00 |
| 合计 | 4,258,340.44 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 债券账户维护费 | 18,800.00 |
| 银行费用 | 6,537.98 |
| 合计 | 219,269.90 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 银华基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 西南证券 | 901,226,543.79 | 31.76% | 333,951,665.14 | 6.41% |
| 东北证券 | - | - | 529,481,121.14 | 10.17% |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 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 成交总额的比例 |
| 东北证券 | - | - | 42,855,320.34 | 6.67% |
| 西南证券 | - | - | 75,678,487.38 | 11.77% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比会计期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | | |
|-------|----------------------------|---------|----------|---------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 |
| | | | | |

| | | 的比例 | | 总额的比例 |
|-------|---------------------------------|------------|------------|--------------|
| 西南证券 | 839,311.57 | 32.13% | 474,985.80 | 47.29% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 | 482,039.58 | 10.17% | 57,449.07 | 3.27% |
| 西南证券 | 304,029.52 | 6.41% | 62,703.84 | 3.57% |

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等）。

(2) 该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2016年1月1日至2016年 6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,802,671.76 | 16,726,570.03 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 598,635.38 | 1,134,233.86 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,467,111.96 | 2,787,761.66 |

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月 30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|--------------------------------|---------------|---------------------------------|----------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | 中国银行 | 65,045,002.97 | 457,965.56 | 183,780,501.38 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

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 | 2016年 3月4日 | - | 2016年 3月 4日 | 1.000 | 36,720,088.05 | 47,816,897.81 | 84,536,985.86 | |
| 合计 | - | - | | 1.000 | 36,720,088.05 | 47,816,897.81 | 84,536,985.86 | |

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 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 |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016 年 6 月 24 日 | 2016 年 7 月 6 日 | 新股流通受限 | 12.98 | 12.98 | 9,314 | 120,895.72 | 120,895.72 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-----------------|------|--------|-----------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 002175 | 东方网络 | 2016 年 5 月 9 日 | 重大事项 | 54.56 | - | - | 998,053 | 49,967,376.36 | 54,453,771.68 | - |
| 300061 | 康耐特 | 2016 年 5 月 5 日 | 重大事项 | 28.84 | 2016 年 7 月 21 日 | 31.56 | 407,655 | 9,831,519.66 | 11,756,770.20 | - |
| 300323 | 华灿光电 | 2016 年 4 月 18 日 | 重大事项 | 8.99 | - | - | 677,645 | 5,989,882.72 | 6,092,028.55 | - |
| 601611 | 中国核电 | 2016 年 6 月 30 日 | 重大事项 | 20.92 | 2016 年 7 月 1 日 | 23.01 | 25,210 | 87,478.70 | 527,393.20 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出权证保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016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 | 65,045,002.97 | - | - | - | - | - | 65,045,002.97 |
| 结算备付金 | 1,436,076.86 | - | - | - | - | - | 1,436,076.86 |
| 存出保证金 | 538,535.35 | - | - | - | - | - | 538,535.35 |
| 交易性金融资产 | 80,008,000.00 | 129,708,000.00 | - | - | 110,655,256.90 | 768,934,880.77 | 1,089,306,137.67 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 94,833.03 | 94,833.03 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 4,821,911.47 | 4,821,911.47 |
| 应收申购款 | 298.22 | - | - | - | - | 17,349.43 | 17,647.65 |
| 其他 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|----------------|-----------------|--------|-----------------|----------------|------------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 资产总计 | 147,027,913.40 | 129,708,000.00 | - | -110,655,256.90 | 773,868,974.70 | 1,161,260,145.00 | |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 1,637,040.54 | 1,637,040.54 | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,401,841.18 | 1,401,841.18 | |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 233,640.20 | 233,640.20 | |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 1,004,672.75 | 1,004,672.75 | |
| 应交税费 | - | - | - | - | 60,187.20 | 60,187.20 | |
| 其他负债 | - | - | - | - | 265,175.68 | 265,175.68 | |
| 负债总计 | - | - | - | - | 4,602,557.55 | 4,602,557.55 | |
| 利率敏感度缺口 | 147,027,913.40 | 129,708,000.00 | - | -110,655,256.90 | 769,266,417.15 | 1,156,657,587.45 | |
| 上年度末 2015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 | 109,495,448.33 | - | - | - | - | - | 109,495,448.33 |
| 结算备付金 | 5,033,347.38 | - | - | - | - | - | 5,033,347.38 |
| 存出保证金 | 543,117.62 | - | - | - | - | - | 543,117.62 |
| 交易 | 80,032,000.00 | -190,123,000.00 | - | 76,191,890.70 | 992,736,164.58 | 1,339,083,055.28 | |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|-----------------|---|----------------|------------------|------------------|
| 性金融资产 | | | | | | | |
| 应收证券清算款 | | - | - | - | - | 31,340,387.09 | 31,340,387.09 |
| 应收利息 | | - | - | - | - | 5,119,571.05 | 5,119,571.05 |
| 应收申购款 | 9,940.36 | - | - | - | - | 361,672.33 | 371,612.69 |
| 其他资产 | | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 195,113,853.69 | | -190,123,000.00 | | -76,191,890.70 | 1,029,557,795.05 | 1,490,986,539.44 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | | - | - | - | - | 1,617,735.52 | 1,617,735.52 |
| 应付管理人报酬 | | - | - | - | - | 1,866,495.85 | 1,866,495.85 |
| 应付托管费 | | - | - | - | - | 311,082.65 | 311,082.65 |
| 应付交易费用 | | - | - | - | - | 1,886,317.24 | 1,886,317.24 |
| 应交税费 | | - | - | - | - | 60,187.20 | 60,187.20 |
| 其他负债 | | - | - | - | - | 460,937.57 | 460,937.57 |
| 负债总计 | | - | - | - | - | 6,202,756.03 | 6,202,756.03 |
| 利率敏感度缺口 | 195,113,853.69 | | -190,123,000.00 | | -76,191,890.70 | 1,023,355,039.02 | 1,484,783,783.41 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|----------------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况； | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； | | |
| | 此项影响并未考虑管理层为减低利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（2016 年 6 月 30 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | +25 个基准点 | -1,521,881.68 | -1,384,543.63 |
| | -25 个基准点 | 1,521,881.68 | 1,384,543.63 |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2015 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 | 768,934,880.77 | 66.48 | 992,736,164.58 | 66.86 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 320,371,256.90 | 27.70 | 346,346,890.70 | 23.33 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |

| | | | | |
|----|------------------|-------|------------------|-------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,089,306,137.67 | 94.18 | 1,339,083,055.28 | 90.19 |

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； | | |
| | 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； | | |
| | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 | | |
| 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（2016 年 6 月 30 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | +5% | 68,670,358.98 | 85,049,322.82 |
| | -5% | -68,670,358.98 | -85,049,322.82 |

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 768,934,880.77 | 66.22 |
| | 其中：股票 | 768,934,880.77 | 66.22 |
| 2 | 固定收益投资 | 320,371,256.90 | 27.59 |
| | 其中：债券 | 320,371,256.90 | 27.59 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 66,481,079.83 | 5.72 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,472,927.50 | 0.47 |
| 8 | 合计 | 1,161,260,145.00 | 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 | 21,892,396.31 | 1.89 |
| B | 采矿业 | 3,240,532.60 | 0.28 |
| C | 制造业 | 456,144,312.84 | 39.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 527,393.20 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 22,026,922.00 | 1.90 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 22,594,322.74 | 1.95 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 163,035,684.28 | 14.10 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 39,352,917.02 | 3.40 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,387,241.86 | 1.59 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 21,686,857.92 | 1.87 |
| 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 | 46,300.00 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 768,934,880.77 | 66.48 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002175 | 东方网络 | 998,053 | 54,453,771.68 | 4.71 |
| 2 | 300033 | 同花顺 | 596,592 | 48,592,418.40 | 4.20 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 2,248,548 | 44,903,503.56 | 3.88 |
| 4 | 300275 | 梅安森 | 1,592,299 | 36,129,264.31 | 3.12 |
| 5 | 300141 | 和顺电气 | 830,599 | 29,320,144.70 | 2.53 |
| 6 | 002743 | 富煌钢构 | 1,663,599 | 23,989,097.58 | 2.07 |
| 7 | 002098 | 浔兴股份 | 1,995,104 | 23,183,108.48 | 2.00 |
| 8 | 600029 | 南方航空 | 3,200,329 | 22,594,322.74 | 1.95 |
| 9 | 300085 | 银之杰 | 754,569 | 22,561,613.10 | 1.95 |
| 10 | 000701 | 厦门信达 | 1,249,400 | 22,026,922.00 | 1.90 |
| 11 | 002285 | 世联行 | 2,793,338 | 21,760,103.02 | 1.88 |
| 12 | 300162 | 雷曼股份 | 936,715 | 20,598,362.85 | 1.78 |
| 13 | 000901 | 航天科技 | 505,350 | 20,289,802.50 | 1.75 |
| 14 | 002593 | 日上集团 | 2,592,561 | 19,755,314.82 | 1.71 |
| 15 | 600735 | 新华锦 | 1,395,892 | 19,584,364.76 | 1.69 |
| 16 | 000892 | 星美联合 | 1,361,859 | 19,270,304.85 | 1.67 |
| 17 | 002402 | 和而泰 | 696,700 | 18,845,735.00 | 1.63 |
| 18 | 600645 | 中源协和 | 522,684 | 18,367,115.76 | 1.59 |
| 19 | 000023 | 深天地A | 703,220 | 18,143,076.00 | 1.57 |
| 20 | 600266 | 北京城建 | 1,406,600 | 17,568,434.00 | 1.52 |
| 21 | 002364 | 中恒电气 | 618,900 | 16,976,427.00 | 1.47 |
| 22 | 002518 | 科士达 | 641,400 | 15,958,032.00 | 1.38 |
| 23 | 601689 | 拓普集团 | 390,299 | 12,860,352.05 | 1.11 |
| 24 | 600728 | 佳都科技 | 1,258,933 | 12,236,828.76 | 1.06 |
| 25 | 002095 | 生意宝 | 218,284 | 12,221,721.16 | 1.06 |
| 26 | 002090 | 金智科技 | 413,682 | 12,149,840.34 | 1.05 |
| 27 | 600536 | 中国软件 | 480,030 | 11,962,347.60 | 1.03 |
| 28 | 300422 | 博世科 | 359,040 | 11,898,585.60 | 1.03 |
| 29 | 300061 | 康耐特 | 407,655 | 11,756,770.20 | 1.02 |
| 30 | 002366 | 台海核电 | 217,800 | 11,610,918.00 | 1.00 |
| 31 | 002438 | 江苏神通 | 528,000 | 11,557,920.00 | 1.00 |
| 32 | 002299 | 圣农发展 | 445,743 | 11,544,743.70 | 1.00 |
| 33 | 603268 | 松发股份 | 282,800 | 11,292,204.00 | 0.98 |
| 34 | 300207 | 欣旺达 | 438,739 | 11,262,430.13 | 0.97 |
| 35 | 002152 | 广电运通 | 679,212 | 11,166,245.28 | 0.97 |
| 36 | 603002 | 宏昌电子 | 1,441,882 | 11,073,653.76 | 0.96 |
| 37 | 002234 | 民和股份 | 351,521 | 10,338,232.61 | 0.89 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 38 | 600688 | 上海石化 | 1,613,100 | 9,839,910.00 | 0.85 |
| 39 | 300070 | 碧水源 | 657,814 | 9,788,272.32 | 0.85 |
| 40 | 603788 | 宁波高发 | 168,828 | 7,939,980.84 | 0.69 |
| 41 | 300323 | 华灿光电 | 677,645 | 6,092,028.55 | 0.53 |
| 42 | 000983 | 西山煤电 | 393,804 | 3,209,502.60 | 0.28 |
| 43 | 601611 | 中国核电 | 25,210 | 527,393.20 | 0.05 |
| 44 | 300474 | 景嘉微 | 2,467 | 372,196.29 | 0.03 |
| 45 | 002475 | 立讯精密 | 16,050 | 315,382.50 | 0.03 |
| 46 | 601127 | 小康股份 | 8,662 | 206,761.94 | 0.02 |
| 47 | 603737 | 三棵树 | 1,327 | 154,038.16 | 0.01 |
| 48 | 601966 | 玲珑轮胎 | 9,314 | 120,895.72 | 0.01 |
| 49 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.01 |
| 50 | 300515 | 三德科技 | 1,355 | 63,508.85 | 0.01 |
| 51 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.01 |
| 52 | 300327 | 中颖电子 | 1,000 | 53,430.00 | 0.00 |
| 53 | 002577 | 雷柏科技 | 1,000 | 51,050.00 | 0.00 |
| 54 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.00 |
| 55 | 600136 | 当代明诚 | 2,000 | 46,300.00 | 0.00 |
| 56 | 000915 | 山大华特 | 1,000 | 35,370.00 | 0.00 |
| 57 | 300078 | 思创医惠 | 1,000 | 33,440.00 | 0.00 |
| 58 | 600340 | 华夏幸福 | 1,000 | 24,380.00 | 0.00 |
| 59 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.00 |
| 60 | 600073 | 上海梅林 | 1,000 | 11,450.00 | 0.00 |
| 61 | 600188 | XD 兖州煤 | 1,000 | 10,940.00 | 0.00 |
| 62 | 002321 | 华英农业 | 1,000 | 9,420.00 | 0.00 |
| 63 | 600123 | 兰花科创 | 1,000 | 7,180.00 | 0.00 |
| 64 | 601699 | 潞安环能 | 1,000 | 6,540.00 | 0.00 |
| 65 | 600348 | 阳泉煤业 | 1,000 | 6,370.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 300033 | 同花顺 | 69,626,161.86 | 4.69 |
| 2 | 600703 | 三安光电 | 45,059,332.03 | 3.03 |
| 3 | 300275 | 梅安森 | 41,226,168.37 | 2.78 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 4 | 000550 | 江铃汽车 | 39,895,309.29 | 2.69 |
| 5 | 002743 | 富煌钢构 | 37,333,588.42 | 2.51 |
| 6 | 600645 | 中源协和 | 35,686,333.20 | 2.40 |
| 7 | 600029 | 南方航空 | 34,730,026.19 | 2.34 |
| 8 | 002285 | 世联行 | 32,919,826.98 | 2.22 |
| 9 | 000892 | 星美联合 | 32,822,766.86 | 2.21 |
| 10 | 300141 | 和顺电气 | 27,721,664.02 | 1.87 |
| 11 | 002175 | 东方网络 | 27,641,794.00 | 1.86 |
| 12 | 002425 | 凯撒股份 | 24,384,095.02 | 1.64 |
| 13 | 000701 | 厦门信达 | 24,182,172.00 | 1.63 |
| 14 | 300422 | 博世科 | 23,946,569.63 | 1.61 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 23,650,104.05 | 1.59 |
| 16 | 002095 | 生意宝 | 22,839,810.63 | 1.54 |
| 17 | 000023 | 深天地A | 22,798,887.50 | 1.54 |
| 18 | 300295 | 三六五网 | 22,541,155.18 | 1.52 |
| 19 | 600536 | 中国软件 | 19,934,177.44 | 1.34 |
| 20 | 000901 | 航天科技 | 19,802,862.50 | 1.33 |

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300058 | 蓝色光标 | 63,581,243.19 | 4.28 |
| 2 | 300085 | 银之杰 | 56,907,334.50 | 3.83 |
| 3 | 002717 | 岭南园林 | 47,219,042.59 | 3.18 |
| 4 | 000550 | 江铃汽车 | 38,143,706.20 | 2.57 |
| 5 | 600055 | 华润万东 | 36,949,465.77 | 2.49 |
| 6 | 600196 | 复星医药 | 34,475,845.28 | 2.32 |
| 7 | 002098 | 浔兴股份 | 31,807,023.45 | 2.14 |
| 8 | 300327 | 中颖电子 | 29,055,337.90 | 1.96 |
| 9 | 300033 | 同花顺 | 28,803,181.06 | 1.94 |
| 10 | 002642 | 荣之联 | 28,797,698.84 | 1.94 |
| 11 | 002593 | 日上集团 | 28,634,811.62 | 1.93 |
| 12 | 300162 | 雷曼股份 | 27,193,223.11 | 1.83 |
| 13 | 600585 | 海螺水泥 | 26,733,380.85 | 1.80 |
| 14 | 300070 | 碧水源 | 26,280,300.15 | 1.77 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 300089 | 文化长城 | 22,203,324.94 | 1.50 |
| 16 | 300295 | 三六五网 | 21,779,677.52 | 1.47 |
| 17 | 600303 | 曙光股份 | 21,577,093.86 | 1.45 |
| 18 | 002425 | 凯撒股份 | 21,417,743.89 | 1.44 |
| 19 | 300113 | 顺网科技 | 21,122,082.82 | 1.42 |
| 20 | 002175 | 东方网络 | 21,097,356.80 | 1.42 |

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,445,166,486.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,393,761,427.82 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 317,228,355.50 | 27.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,142,901.40 | 0.27 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 320,371,256.90 | 27.70 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 150015 | 15 付息国债 15 | 800,000 | 80,008,000.00 | 6.92 |
| 2 | 150020 | 15 付息国债 20 | 700,000 | 70,014,000.00 | 6.05 |

| | | | | | |
|---|--------|---------------|---------|---------------|------|
| 3 | 010303 | 03 国债(3) | 634,870 | 65,753,485.90 | 5.68 |
| 4 | 010107 | 21 国债(7) | 386,370 | 41,758,869.60 | 3.61 |
| 5 | 150018 | 15 付息国债 18 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.73 |

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中包括同花顺（证券代码 300033）

根据浙江核新同花顺网络信息股份有限公司于 2015 年 8 月 18 日发布的公告，于近日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对同花顺的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 | 538,535.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 94,833.03 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,821,911.47 |
| 5 | 应收申购款 | 17,647.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,472,927.50 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1 | 123001 | 蓝标转债 | 3,142,901.40 | 0.27 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|----------|
| 1 | 002175 | 东方网络 | 54,453,771.68 | 4.71 | 重大事项 |

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，各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 |
| 52,208 | 16,753.11 | 5,447,820.03 | 0.62% | 869,198,705.27 | 99.38% |

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 | 81.31 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2002 年 11 月 13 日）基金份额总额 | 1,682,572,543.63 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 842,627,810.24 |
| 本报告期基金总申购份额 | 65,824,136.65 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 33,805,421.59 |
| 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 | 874,646,525.30 |

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**10.2.1 基金管理人的重大人事变动**

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

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，本基金管理人和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例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 西南证券股份有限公司 | 2 | 901,226,543.79 | 31.76% | 839,311.57 | 32.13% | - |
| 华融证券股份有限公司 | 2 | 460,765,510.83 | 16.24% | 429,109.68 | 16.43% | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | 383,151,747.63 | 13.50% | 356,829.43 | 13.66% | 撤销 1 个交易单元 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | 365,902,373.04 | 12.89% | 340,765.83 | 13.05% | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 3 | 276,360,824.25 | 9.74% | 257,372.66 | 9.85% | - |
| 华创证券有限责任公司 | 2 | 129,906,515.71 | 4.58% | 95,000.62 | 3.64% | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3 | 83,750,617.50 | 2.95% | 77,997.39 | 2.99% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | 64,380,212.53 | 2.27% | 59,957.27 | 2.30% | - |
| 北京高华证券 | 1 | 63,777,608.42 | 2.25% | 59,396.54 | 2.27% | - |

| | | | | | | | |
|------------------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|---|
| 有限责任公司 | | | | | | | |
| 恒泰证券股份 有限公司 | 1 | 49,663,834.40 | 1.75% | 46,251.97 | 1.77% | - | - |
| 川财证券有限 责任公司 | 2 | 24,421,337.39 | 0.86% | 17,859.09 | 0.68% | - | - |
| 华鑫证券有限 责任公司 | 1 | 14,249,906.30 | 0.50% | 13,270.98 | 0.51% | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | 1 | 7,294,634.74 | 0.26% | 6,793.49 | 0.26% | - | - |
| 国海证券股份 有限公司 | 1 | 6,884,014.00 | 0.24% | 6,410.98 | 0.25% | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | 1 | 6,126,502.17 | 0.22% | 5,705.70 | 0.22% | - | - |
| 大同证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团 股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 国开证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限 | 1 | - | - | - | - | - | - |

| 公司 | | | | | | |
|------------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 国金证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券股份 有限公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易 单元 |
| 中信证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 财达证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券 有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中天证券有限 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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------------|----------------|----------------------|----------------|----------------------------|------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比 例 | 成交金额 | 占当期债 券回购 成交总额 的比例 | 成交金额 | 占当期权证 成交总额的 比例 |
| 西南证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份 有限公司 | 247,107,994.80 | 62.77% | 252,300,000.00 | 88.81% | - | - |
| 国泰君安证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------|----------------|--------|---------------|--------|---|---|
| 渤海证券股份 有限公司 | 133,918,311.50 | 34.02% | 31,800,000.00 | 11.19% | - | - |
| 华创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券有限 责任公司 | 12,627,347.90 | 3.21% | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 大同证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国开证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|--------------------|----------------|
| 1 | 《银华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值公 告》 | 三大证券报及本基 金管理人网站 | 2016 年 1 月 4 日 |
| 2 | 《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 4 日发生指数熔断 调整旗下基金申购、赎回等业务 | 三大证券报及本基 金管理人网站 | 2016 年 1 月 5 日 |

| | | | |
|----|---|----------------|-----------------|
| | 办理时间的公告》 | | |
| 3 | 《银华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 6 日 |
| 4 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的德尔未来、文化长城、格林美、万里扬、宏图高科估值方法调整的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 7 日 |
| 5 | 《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 7 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》 | 本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 7 日 |
| 6 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的百洋股份估值方法调整的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 14 日 |
| 7 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的亚太股份、旋极信息、光环新网估值方法调整的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 15 日 |
| 8 | 《银华优势企业证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 1 月 22 日 |
| 9 | 《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在平安证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 2 月 26 日 |
| 10 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中源协和、天银机电估值方法调整的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2016 年 3 月 2 日 |
| 11 | 《银华优势企业证券投资基金分 | 三大证券报及本基 | 2016 年 3 月 2 日 |

| | | | |
|----|--|---------------------|-----------------|
| | 红公告》 | 金管理人网站 | |
| 12 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券投资咨询有限公司网上费率优惠活动的公告》 | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 15 日 |
| 13 | 《关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》 | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 16 日 |
| 14 | 《银华优势企业证券投资基金 2015 年年度报告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 15 | 《银华优势企业证券投资基金 2015 年年度报告摘要》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 16 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 31 日 |
| 17 | 《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在上海证券开通定期定额投资业务的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 19 日 |
| 18 | 《银华优势企业证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 21 日 |
| 19 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东方网络估值方法调整的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 14 日 |
| 20 | 《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在大同证券开通定期定额投资业务的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 19 日 |
| 21 | 《银华基金管理有限公司关于旗 | 三大证券报及本基 | 2016 年 5 月 26 日 |

| | | | |
|----|---|---------------------|------------|
| | 下部分基金参加民生银行直销银行“基金通”平台费率优惠活动的公告》 | 金管理人网站 | |
| 22 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016年6月14日 |
| 23 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海联泰资产管理有限公司网上费率优惠活动的公告》 | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016年6月17日 |
| 24 | 《银华优势企业证券投资基金更新招募说明书（2016年第1号）》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016年6月27日 |
| 25 | 《银华优势企业证券投资基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016年6月27日 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2016年7月21日发布公告，自2016年7月26日起调整本基金每笔赎回申请的最低份额、转换转出最低份额及赎回后的最低保有份额。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华优势企业证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华优势企业证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华优势企业证券投资基金基金合同》

- 12.1.4 《银华优势企业证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理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
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理有限公司
2016年8月24日