

# 银华中证国防安全指数分级证券投资基金 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：海通证券股份有限公司

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。

基金托管人海通证券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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
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.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39

7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 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.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
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.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证国防安全指数分级证券投资基金		
基金简称	银华中证国防安全指数分级		
场内简称	国安分级		
基金主代码	161832		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	海通证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	6,835,281.45 份		
基金合同存续期	不定期		
上市日期	-		
下属分级基金的基金简称	国安 A	国安 B	国安分级
下属分级基金的交易代码	150351	150352	161832
报告期末下属分级基金份 额总额	280,103.00 份	280,104.00 份	6,275,074.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国防安全指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制法，按照成份股在中证国防安全指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国防安全指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证国防安全指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>		
业绩比较基准	95%×中证国防安全指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。		
下属分级基金的风险收益 特征	低风险、收益相对稳 定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期 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	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	朱稼翔
	联系电话	(010)58163000	(021) 63411463
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhujx@htsec.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	(021) 95553
传真		(010)58163027	(021) 63410637
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	上海市黄浦区广东路 689 号海 通证券大厦
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	上海市黄浦区广东路 689 号海 通证券大厦
邮政编码		100738	200001
法定代表人		王珠林	王开国

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §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	626,830.92
本期利润	638,085.01
加权平均基金份额本期利润	0.0655
本期加权平均净值利润率	6.09%
本期基金份额净值增长率	7.66%
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	396,236.93

期末可供分配基金份额利润	0.0580
期末基金资产净值	7,586,134.10
期末基金份额净值	1.110
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	11.91%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

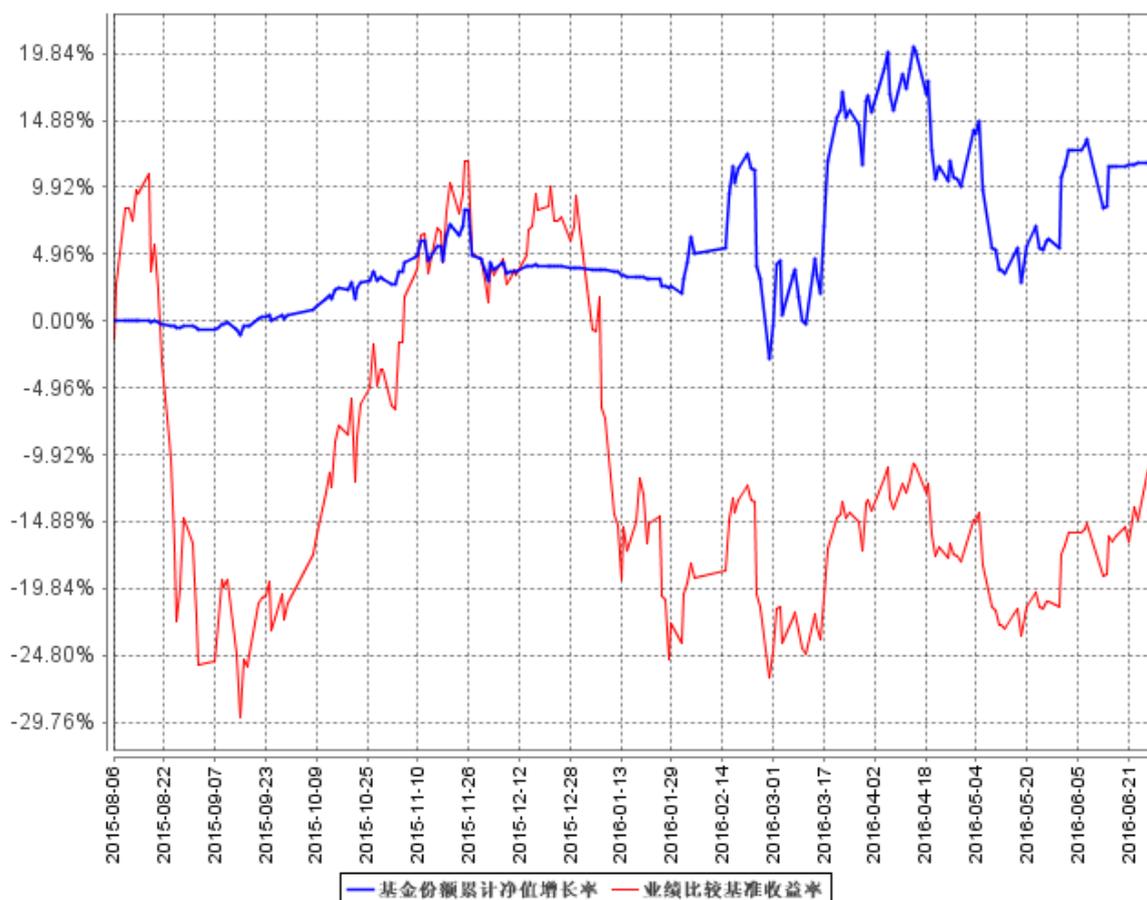
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.19%	1.25%	8.01%	1.77%	-6.82%	-0.52%
过去三个月	-4.15%	1.75%	2.94%	1.89%	-7.09%	-0.14%
过去六个月	7.66%	1.96%	-16.47%	2.74%	24.13%	-0.78%
自基金合同生效起至今	11.91%	1.50%	-10.66%	2.94%	22.57%	-1.44%

注：本基金业绩比较基准为：95%×中证国防安全指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

如本基金标的指数变化，则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。业绩比较基准的调整根据标的指数的变更程序执行。

### 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：基金的投资组合比例为：本基金所持的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%–100%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证国防安全指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人管理着 62 只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金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、银华中证国防安全指数分级证券投资基金、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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。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		
马君女士	本基金的 基金经理	2015 年 8 月 6 日	-	7 年	硕士学位。2008 年 9 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理职务，自 2012 年 9 月 4 日起担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理。自 2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月 13 日起兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证国防安全指数分级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

2016 年上半年 A 股市场大幅震荡，先跌后小幅反弹，整体大幅下跌。整个上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，中证国安指数下跌 17.48%。一季度市场下跌过程中，高估值品种成为杀跌的重灾区，中证国安成分股跑输大盘，但我们采用量化择时模型，选择了市场底部建仓，因此一季度避免了大幅损失，在一季度末二季度初的反弹中，中证国安指数成分股开始估值回归，有超越大盘的相对收益，上半年本基金跑赢业绩比较基准，给投资人创造了正收益。

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金基金份额净值为 1.110 元，本报告期份额净值增长率为 7.66%，同期业绩比较基准收益率为-16.47%。报告期内，二月中旬之前，本基金仍处于建仓期，六月份开始，本基金启动清盘程序，由于建仓期不受跟踪误差限制，启动清盘程序后大额申购赎回又较多，指数波动较大，导致跟踪误差少许扩大。

#### 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 2016 年下半年，由于二季度地产延续去年底稳增长促地产政策带来的地产销售量价齐升局面，销量有所回落，价格仍居高位，经济平稳过渡态势明显，2016 年以来央行采取了货币走廊 OMO+MLF+PSL 等一系列工具作为货币政策新主打的背景下，流动性缺口足可应对，同时，英国脱欧事件中，人民币顺势贬值，再次体现了汇率管理的能力，预计三季度央行依旧会维持资金面平稳格局，货币政策上保持实质稳健。流动性平稳的背景下，预计市场整体依旧会延续震荡的格局，但仍可以从基本面角度投资于景气度较高的行业或者公司。在英国脱欧，全球预计动荡的过程中，我国政府表现出了较为强硬的稳定姿态，国防军工和信息安全类股票再度被有利多预期，有跑赢大盘的超额收益，未来在军费支出稳步增长、军民融合加快和信息安全地位提升的大背景下，存量市场博弈中我们依旧看好国防安全领域的超额收益，但国安板块是高波动高贝塔的板块，需极度提防市场下跌的系统性风险。

#### 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

根据本基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括国安分级份额、国安 A 份额、国安 B 份额）不进行收益分配。

#### 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2015 年 12 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日。本基金已召开基金份额持有人大会，并于 2016 年 6 月 7 日审议通过了《关于终止银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》的决议，本基金已于 2016 年 6 月 15 日起进入清算程序，并于 2016 年 8 月 5 日披露了清算报告。

### §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中证国防安全指数分级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，银华中证国防安全指数分级证券投资基金的管理人——银华基金管理有限公司在银华中证国防安全指数分级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，银华中证国防安全指数分级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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理有限公司编制和披露的银华中证国防安全指数分级证券投资基金 2016 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：银华中证国防安全指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,229,358.21	1,584,308.60
结算备付金		1,328.69	61,904.76
存出保证金		15,039.02	3,407.64
交易性金融资产	6.4.7.2	243,658.92	327,066.00
其中：股票投资		243,658.92	327,066.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		95,445.98	7,001,362.06
应收利息	6.4.7.5	1,443.82	856.47
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,586,274.64	8,978,905.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		-	121,382.46
应付管理人报酬		-	12,684.62
应付托管费		-	2,536.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	140.54	3,486.79
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	-	135,474.65
负债合计		140.54	275,565.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,775,670.98	8,367,700.64
未分配利润	6.4.7.10	810,463.12	335,639.42
所有者权益合计		7,586,134.10	8,703,340.06
负债和所有者权益总计		7,586,274.64	8,978,905.53

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，国安分级基金份额净值为 1.110 元，国安 A 基金份额净值为 1.029 元，国安 B 基金份额净值为 1.191 元；基金份额总额为 6,835,281.45 份，其中国安分级份额总额 6,275,074.45 份，国安 A 份额总额 280,103.00 份，国安 B 份额总额 280,104.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证国防安全指数分级证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		891,539.35
1.利息收入		15,600.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,768.63
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		3,832.20
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		828,205.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	817,594.62
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	10,610.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,254.09
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	36,478.98
<b>减：二、费用</b>		253,454.34

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	48,833.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,766.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	45,898.02
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	148,956.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		638,085.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		638,085.01

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 6 日，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证国防安全指数分级证券投资基金

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）	8,367,700.64	335,639.42	8,703,340.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	638,085.01	638,085.01
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）	-1,592,029.66	-163,261.31	-1,755,290.97
其中：1. 基金申购款	25,808,017.78	1,618,448.41	27,426,466.19
2. 基金赎回款	-27,400,047.44	-1,781,709.72	-29,181,757.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,775,670.98	810,463.12	7,586,134.10

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 6 日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>杨清</u>	<u>龚飒</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

#### 1、基本情况

银华中证国防安全指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 2015[1560] 号文注册并公开发售。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 297,198,939.14 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。《银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 6 日正式生效。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)。

本基金的基金份额包括银华中证国防安全指数分级证券投资基金之基础份额(即“国安分级”)、银华中证国防安全指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“国安 A”)与银华中证国防安全指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“国安 B”)。其中,国安 A、国安 B 的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

在国安 A、国安分级存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日,本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。对于国安 A 期末的约定应得收益,即国安 A 每个定期折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分,将折算为场内国安分级分配给国安 A 持有人。国安分级持有人持有的每 2 份国安分级将按 1 份国安 A 获得新增国安分级的分配。持有场外国安分级的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国安分级的分配;持有场内国安分级的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国安分级的分配。经过上述份额折算,国安 A 和国安分级的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行份额折算,即:当国安分级的基金

份额净值达到 1.500 元及以上；当国安 B 的基金份额净值达到 0.250 元及以下。当国安分级的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对国安 A、国安 B 和银华国安进行份额折算，份额折算后本基金将确保国安 A 和国安 B 的比例为 1:1，份额折算后国安 A、国安 B 和银华国安的基金份额净值均调整为 1 元。当国安 B 的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对国安 A、国安 B 和银华国安进行份额折算，份额折算后本基金将确保国安 A 和国安 B 的比例为 1:1，份额折算后国安分级、国安 A 和国安 B 的基金份额净值均调整为 1 元。

国安分级设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。国安 A 与国安 B 交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回国安分级，投资者可选择将其场内申购的国安分级按 1:1 的比例分拆成国安 A 和国安 B。投资者可按 1:1 的配比将其持有的国安 A 和国安 B 申请合并为国安分级后场内赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华中证国防安全指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规允许的金融工具包括中证国防安全指数的成份股、备选成份股、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的业绩比较基准为  $95\% \times$  中证国防安全指数收益率  $+5\% \times$  银行活期存款利率（税后）。

## 2、基金清算

依据本基金基金份额持有人大会审议通过的《关于终止银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同相关事项的议案》，本基金依法进行基金财产的清算。

## 3、清算期间

本基金的清算期间为 2016 年 6 月 15 日至 2016 年 6 月 24 日止。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则以及 2014 年新颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

### 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

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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》

及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；
- (3) 对基金所持上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，2015 年 9 月 8 日之前其股息红利所得暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；
- (4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；
- (5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；
- (6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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	7,229,358.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,229,358.21

### 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	222,026.83	243,658.92	21,632.09
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	222,026.83	243,658.92	21,632.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于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

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,436.52
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	0.60
应收债券利息	-
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	6.70
合计	1,443.82

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于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	140.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	140.54

#### 6.4.7.8 其他负债

注：本基金于本报告期末未持有其他负债。

#### 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	8,440,437.75	8,367,700.64
本期申购	26,028,562.40	25,808,017.78
本期赎回(以“-”号填列)	-27,633,718.70	-27,400,047.44
- 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	6,835,281.45	6,775,670.98

注：根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回国安分级，国安A和国安B只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露国安A和国安B的情况。

#### 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	-171,230.12	506,869.54	335,639.42
本期利润	626,830.92	11,254.09	638,085.01
本期基金份额交易产生的变动数	-59,363.87	-103,897.44	-163,261.31
其中：基金申购款	-438,279.64	2,056,728.05	1,618,448.41
基金赎回款	378,915.77	-2,160,625.49	-1,781,709.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	396,236.93	414,226.19	810,463.12

#### 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	10,621.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,058.98
其他	87.80
合计	11,768.63

#### 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	15,403,590.65
减：卖出股票成本总额	14,585,996.03
买卖股票差价收入	817,594.62

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 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	10,610.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,610.83

#### 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	11,254.09
——股票投资	11,254.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	11,254.09

#### 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	36,478.98
合计	36,478.98

#### 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	45,898.02
银行间市场交易费用	-
合计	45,898.02

#### 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	-
信息披露费	45,000.00
银行费用	765.00
指数使用费	91,191.59
账户服务费	12,000.00
合计	148,956.59

## 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不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。

### 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
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	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

本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 6 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
海通证券	29,894,925.51	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例

海通证券	50,500,000.00	100.00%
------	---------------	---------

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末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 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
海通证券	27,841.66	100.00%	140.54	100.00%

#### 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	
	当期发生的基金应支付的管理费	48,833.12
其中：支付销售机构的客户维护费	15,090.77	

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

##### 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	
----	----------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	9,766.61
----------------	----------

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期基金管理人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：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
海通证券	7,229,358.21	10,621.85

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括国安分级、国安 A、国安 B）不进行收益分配。

### 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

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002190	成飞集成	2016年4月21日	重大事项	35.44	2016年7月12日	38.98	2,899	89,072.40	102,740.56	-
002046	轴研科技	2016年5月9日	重大事项	10.33	-	-	8,196	71,195.92	84,664.68	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	4,522	61,758.51	56,253.68	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基本资产净值的 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较小；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，除在附注 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，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。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、存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	7,229,358.21	-	-	-	-	-	7,229,358.21
结算备付金	1,328.69	-	-	-	-	-	1,328.69
存出保证金	15,039.02	-	-	-	-	-	15,039.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	243,658.92	243,658.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	95,445.98	95,445.98
应收利息	-	-	-	-	-	1,443.82	1,443.82
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,245,725.92	-	-	-	-	340,548.72	7,586,274.64
负债							
应付交易费用	-	-	-	-	-	140.54	140.54
负债总计	-	-	-	-	-	140.54	140.54
利率敏感度缺口	7,245,725.92	-	-	-	-	340,408.18	7,586,134.10
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	1,584,308.60	-	-	-	-	-	1,584,308.60
结算备付金	61,904.76	-	-	-	-	-	61,904.76
存出保证金	3,407.64	-	-	-	-	-	3,407.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	327,066.00	327,066.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,001,362.06	7,001,362.06
应收利息	-	-	-	-	-	856.47	856.47
资产总计	1,649,621.00	-	-	-	-	7,329,284.53	8,978,905.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	121,382.46	121,382.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,684.62	12,684.62
应付托管费	-	-	-	-	-	2,536.95	2,536.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,486.79	3,486.79
其他负债	-	-	-	-	-	135,474.65	135,474.65
负债总计	-	-	-	-	-	275,565.47	275,565.47
利率敏感度缺口	1,649,621.00	-	-	-	-	7,053,719.06	8,703,340.06

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

在资产类别配置上，基金的投资组合比例为：本基金所持的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证国防安全指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	243,658.92	3.21	327,066.00	3.76
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	243,658.92	3.21	327,066.00	3.76

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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	243,658.92	3.21
	其中：股票	243,658.92	3.21
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,230,686.90	95.31
7	其他各项资产	111,928.82	1.48
8	合计	7,586,274.64	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	243,658.92	3.21
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	243,658.92	3.21

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.2.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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	002190	成飞集成	2,899	102,740.56	1.35
2	002046	轴研科技	8,196	84,664.68	1.12
3	002465	海格通信	4,522	56,253.68	0.74

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

### 7.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	000561	烽火电子	189,344.00	2.18
2	300271	华宇软件	179,720.00	2.06
3	002465	海格通信	179,419.00	2.06
4	000738	中航动控	174,649.00	2.01
5	600562	国睿科技	167,724.00	1.93
6	600677	航天通信	160,148.00	1.84
7	002313	日海通讯	158,757.00	1.82
8	300458	全志科技	158,666.00	1.82
9	300065	海兰信	157,687.00	1.81
10	002104	恒宝股份	155,876.00	1.79
11	002401	中海科技	153,216.00	1.76
12	002013	中航机电	153,141.00	1.76
13	002214	大立科技	153,013.64	1.76
14	600391	成发科技	152,795.00	1.76
15	300297	蓝盾股份	151,187.00	1.74
16	300036	超图软件	149,183.00	1.71
17	002179	中航光电	149,118.00	1.71
18	002197	证通电子	148,495.00	1.71
19	000801	四川九洲	147,705.00	1.70
20	002446	盛路通信	147,344.00	1.69

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	300036	超图软件	221,613.47	2.55
2	300386	飞天诚信	202,295.00	2.32
3	000561	烽火电子	199,428.47	2.29
4	600562	国睿科技	193,916.51	2.23
5	002179	中航光电	180,481.00	2.07

6	002313	日海通讯	180,345.31	2.07
7	002253	川大智胜	173,890.50	2.00
8	300271	华宇软件	173,292.83	1.99
9	300065	海兰信	172,157.00	1.98
10	600355	精伦电子	171,370.28	1.97
11	300034	钢研高纳	169,975.63	1.95
12	300458	全志科技	169,891.50	1.95
13	600570	恒生电子	167,777.88	1.93
14	300053	欧比特	166,247.00	1.91
15	002151	北斗星通	163,008.00	1.87
16	002446	盛路通信	161,430.30	1.85
17	600151	航天机电	160,407.13	1.84
18	002177	御银股份	158,341.56	1.82
19	300045	华力创通	157,298.00	1.81
20	002214	大立科技	157,263.44	1.81

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	14,491,334.86
卖出股票收入（成交）总额	15,403,590.65

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	15,039.02
2	应收证券清算款	95,445.98
3	应收股利	-
4	应收利息	1,443.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,928.82

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资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	002190	成飞集成	102,740.56	1.35	重大事项

2	002046	轴研科技	84,664.68	1.12	重大事项
3	002465	海格通信	56,253.68	0.74	重大事项

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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

份额级别	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
国安 A	92	3,044.60	3.00	0.00%	280,100.00	100.00%
国安 B	93	3,011.87	5.00	0.00%	280,099.00	100.00%
国安分级	665	9,436.20	0.00	0.00%	6,275,074.45	100.00%
合计	850	8,041.51	8.00	0.00%	6,835,273.45	100.00%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

国安 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	项箴怡	50,002.00	17.85%
2	高霞如	50,001.00	17.85%
3	舒金兰	25,502.00	9.10%
4	聂宏杰	25,001.00	8.93%
5	张熠	25,001.00	8.93%
6	傅瑶	25,001.00	8.93%
7	韩冰	25,001.00	8.93%
8	李龙钢	25,000.00	8.93%

9	赵永轩	25,000.00	8.93%
10	曹金明	4,501.00	1.61%

## 国安B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	项箴怡	50,002.00	17.85%
2	高霞如	50,000.00	17.85%
3	舒金兰	25,501.00	9.10%
4	聂宏杰	25,001.00	8.93%
5	张熠	25,001.00	8.93%
6	傅瑶	25,001.00	8.93%
7	韩冰	25,001.00	8.93%
8	李龙钢	25,000.00	8.93%
9	赵永轩	25,000.00	8.93%
10	曹金明	4,501.00	1.61%

## 国安分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	魏军	100,845.00	28.40%
2	陶强	50,423.00	14.20%
3	杨尔健	50,423.00	14.20%
4	季浏宁	50,421.00	14.20%
5	兰映霞	50,420.00	14.20%
6	陈荟屹	50,420.00	14.20%
7	舒金兰	429.00	0.12%
8	李龙钢	420.00	0.12%
9	赵永轩	420.00	0.12%
10	张熠	420.00	0.12%
11	傅瑶	420.00	0.12%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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

项目	国安 A	国安 B	国安分级
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）	-	-	-
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	1,216,308.00	1,216,309.00	6,007,820.75
本报告期基金总申购份额	-	-	26,028,562.40
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	27,633,718.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-936,205.00	-936,205.00	1,872,410.00
本报告期期末基金份额总额	280,103.00	280,104.00	6,275,074.45

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会于 2016 年 6 月 7 日审议并通过了《关于终止银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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，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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股份有限公司	2	29,894,925.51	100.00%	27,841.66	100.00%	-

注：（1）本基金本报告期末通过证券公司交易单元进行权证交易。

（2）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。

（3）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
海通证券股份有限公司	-	-	50,500,000.00	100.00%	-	-

## 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、赎回等业务办理时间的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报及本基	2016 年 1 月 6 日

	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》	金管理人网站	
4	《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》	本基金管理人网站	2016年1月7日
5	《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管理人网站	2016年1月15日
6	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金2015年第4季度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016年1月22日
7	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的宝通科技、凯撒旅游、航天科技、梅花生物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1月28日
8	《银华基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理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11日
9	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金暂停申购（含定期定额投资）业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016年3月17日
10	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金更新招募说明书（2016年第1号）》	上海证券报及本基金管理人网站	2016年3月22日
11	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）》	上海证券报及本基金管理人网站	2016年3月22日
12	《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016年3月24日
13	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的四维图新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3月25日
14	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金2015年年度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016年3月25日
15	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金2015年年度报告摘要》	上海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调整招商银行借记卡网上直销定期定额申购业务费率优惠的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016年4月1日

17	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
18	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的银之杰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 4 月 22 日
19	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金恢复办理申购业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 3 日
20	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 4 日
21	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 5 日
22	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的启明星辰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
24	《银华基金管理有限公司关于淘宝店业务及网上直销支付宝渠道下线的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 18 日
25	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金暂停申购业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 26 日
26	《关于银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 8 日
27	《关于银华中证国防安全指数分级证券投资基金进入清算期及停止办理申购、赎回、转托管及配对转换业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 14 日
28	《关于开通通联支付渠道网上直销定期定额申购业务的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
29	《银华中证国防安全指数分级证券投资基金暂停申购业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 26 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2016 年 5 月 4 日发布公告，本基金自 2016 年 5 月 16 日起至 2016 年 6 月 6 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

2、本基金管理人于 2016 年 6 月 8 日发布公告，本基金份额持有人大会已于 2016 年 6 月 7 日审议并通过了《关于终止银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金已于 2016 年 6 月 15 日起进入清算程序，停止办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管及配对转换业务。

3、本基金管理人于 2016 年 8 月 5 日对外披露了本基金清算报告，本基金最终清算结果以清算报告为准，自清算报告公告之日起，本基金基金合同终止。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华中证国防安全指数分级证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《银华中证国防安全指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.4 《银华中证国防安全指数分级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 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相

关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日