

# 银华双动力债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## §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 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华双动力债券型证券投资基金
基金简称	银华双动力债券
基金主代码	002481
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 6 日
基金管理人	银华基金管理有限公司
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	304,831,859.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握股票市场和债券市场的收益率变化，在控制风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	<p>本基金将在基金合同约定的范围内实施稳健的大类资产配置，通过对国内外宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的综合分析，综合评价各类资产收益率变化状况。在此基础上，本基金将积极主动地对权益类资产和固定收益类资产的配置比例进行实时动态调整，确定组合的最优资产配置比例和风险水平。</p> <p>本基金投资组合比例为：债券投资占基金资产的比例不低于 80%，权益类资产（包括股票、权证等）投资占基金资产的比例为 0% - 20%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。</p>
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险、预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		银华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	洪渊
	联系电话	(010)58163000	(010)66105799
	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)66105798

## 2.4 信息披露方式

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

## §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4月5日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	1,926,938.51
本期利润	1,536,974.74
加权平均基金份额本期利润	0.0061
本期加权平均净值利润率	0.58%
本期基金份额净值增长率	0.60%
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	1,775,537.37
期末可供分配基金份额利润	0.0058
期末基金资产净值	306,607,397.02
期末基金份额净值	1.006
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	0.60%

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

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

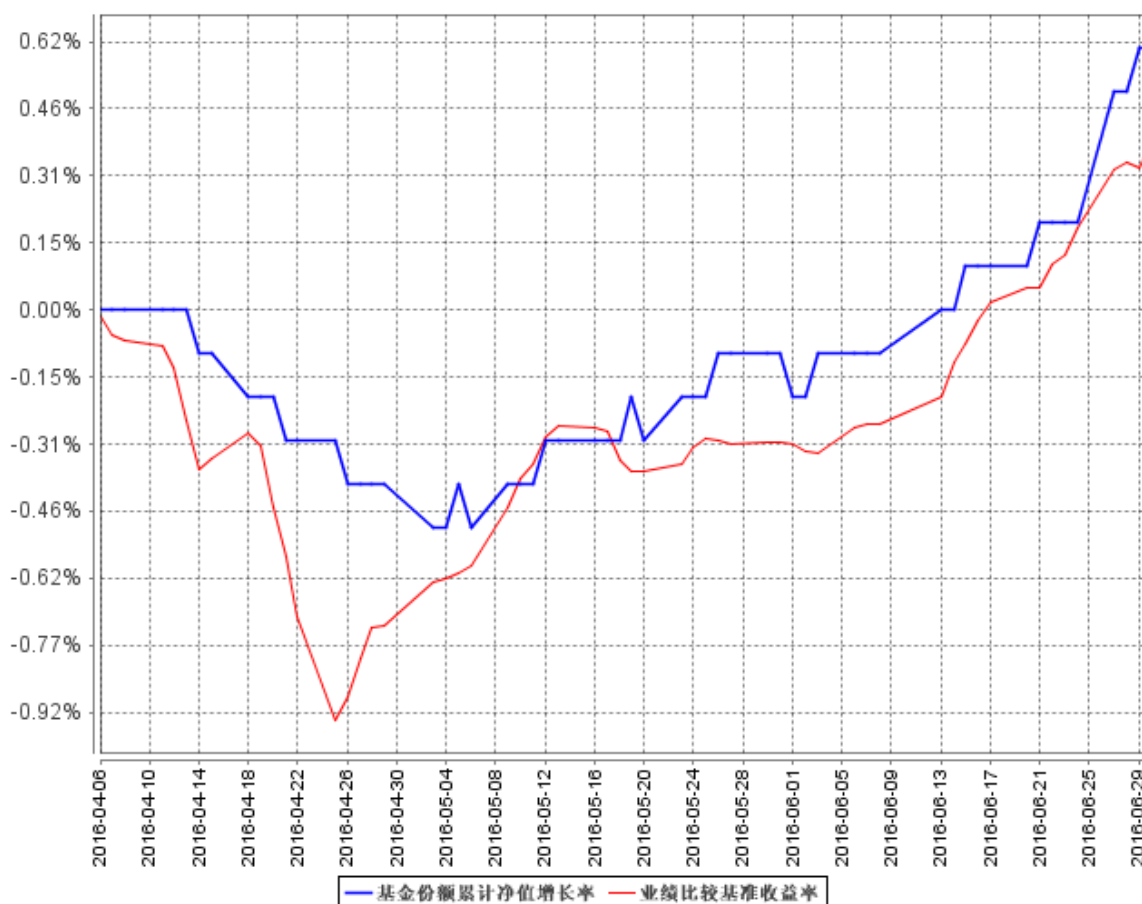
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.70%	0.08%	0.69%	0.04%	0.01%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.07%	0.38%	0.07%	0.22%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率。中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金的固定收益投资部分业绩基准。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2016 年 4 月 6 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时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 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		
瞿灿女士	本基金的基金经理	2016 年 4 月 6 日	-	4 年	硕士学位；2011 年至 2013 年任职于安信证券研究所；2013 年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 2015 年 5 月 25 日起兼任银华永益分级债券型证券投资基金及银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理，自 2016 年 2 月 15 日起兼任银华永利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 3 月 18 日起兼任银华合利债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
王智伟先生	本基金的基金经理	2016 年 7 月 26 日	-	5 年	硕士学位；曾就职于天相投资顾问有限公司、中国证券报有限责任公司、方正证券股份有限公司，2015 年 6 月加盟银华基金管理有限公司，曾任基金经理助理职务，自 2016 年 7 月 26 日起兼任银华合利债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《银华双动力债券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

2016 年上半年，随着前期积极财政政策的持续发力，以及宽松的地产政策推动，一季度经济出现企稳迹象，包括发电耗煤、高炉开工率在内的高频数据出现明显好转，房地产销售同比快速增长，经济各项数据在 3 月达到高点。与此同时，在寒潮影响下蔬菜供应短缺叠加猪肉供需缺口，推动通胀出现上升。4 月之后，随着地产政策有所收紧，地产销售和投资双双回落，制造业投资快速下滑，其中民间投资显著萎缩，经济增速再次出现放缓。同期，蔬菜价格快速下行带动通胀回落。6 月底，英国脱欧加剧了全球经济增长的不确定性，导致全球避险情绪升温。在此过程中，央行货币政策维持稳健基调，通过多种货币政策工具灵活调节银行体系流动性，资金面状况整体维持稳定。

债市方面，一季度债券市场收益率总体震荡，不同品种表现分化，短端利率债及信用债收益率下行为主，幅度在 20-40bp 左右，中长期利率债收益率稳中有上，10 年期金融债收益率上行 5-10bp。进入二季度之后，市场波动有所加剧，4 月份债券收益率在经济增长反弹预期和信用事件推动下出现普遍大幅上行。其后，随着基本面弱化及 6 月底英国脱欧事件的助推下，收益率再度下行。总体来看，今年上半年债市波动较大。股市方面，尽管 2016 年一季度开局不利，但随着内外部风险事件逐步兑现消化，A 股开启阶段式修复。二季度市场整体出现企稳反弹，但波动较大，信用风险释放、“权威人士”发表对经济的看法、美国加息预期升温、A 股未纳入 MSCI 指数、“脱欧”事件等不断扰动市场的预期，走势以震荡为主，且幅度较大。

自本基金成立至本报告期末，本基金初步完成了建仓工作。主要配置的债券品种为中高资质信用债，同时根据市场和规模变动情况不断优化组合结构。本基金在权益类资产上的操作较为谨慎，在存量博弈格局下，主要以小仓位择时策略应对，选择确定性高的主题和个股布局。

#### 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 1.006 元，本报告期份额净值增长率为 0.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 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，海外经济形势仍较为复杂，全球需求持续疲弱。国内经济方面，房地产销售的回落将带动地产投资逐步下行，行业中普遍的产能过剩状况叠加供给侧改革的深化仍将对制造业投资形成制约，预计经济增长未来稳中有降。通胀方面，随着生猪供给的恢复，猪肉价格同比涨幅可能逐步回落，在基数影响下 CPI 先下后上，但整体不足为惧。资金面方面，央行将继续采取利率走廊的形式稳定短端市场利率，随着增长放缓、海外风险加剧，货币政策宽松的可能性有所加大。综合而言，认为未来债券市场仍存在一定机会，但仍需关注结构性产能过剩及供给侧改革导致局部信用风险事件爆发概率进一步上升。因此，操作上仍将严格规避低评级品种，密切关注行业及个券信用状况。股市方面，市场呈震荡格局概率较高，但存在结构性及波段操作机会。未来影响市场的核心变量依然是存量资金的风险偏好，而决定风险偏好的最重要因素则是改革预期。

策略上，本基金将根据市场情况积极进行大类资产配置。纯债类资产将维持适度杠杆水平，采取中性久期，在严格控制信用风险的前提下，对组合配置进行优化调整。权益类资产的投资策略依然优先考虑安全边际，努力把握结构性机会及波段操作机会。总体上看，投资方向将持续关注 1) 景气向上的新兴产业，如半导体、物联网等、军民融合等；2) 需求稳健且存在提价预期

和空间的消费品，如白酒等；以及 3) 自下而上的优质成长股。

#### 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

本基金于 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

#### 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双动力债券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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了

监督，未发现基金管理人有关害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华双动力债券型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年6月30日
<b>资 产：</b>	
银行存款	611,524.35
结算备付金	1,406,923.99
存出保证金	22,367.38
交易性金融资产	319,273,485.66
其中：股票投资	9,583,912.26
基金投资	-
债券投资	309,689,573.40
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	571,488.66
应收利息	5,552,363.08
应收股利	-
应收申购款	39,999,000.00
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	367,437,153.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016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	-

卖出回购金融资产款	60,000,000.00
应付证券清算款	608,910.97
应付赎回款	-
应付管理人报酬	152,195.06
应付托管费	21,742.17
应付销售服务费	-
应付交易费用	10,277.92
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	36,629.98
负债合计	60,829,756.10
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	304,831,859.65
未分配利润	1,775,537.37
所有者权益合计	306,607,397.02
负债和所有者权益总计	367,437,153.12

注：1. 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，银华双动力债券基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 304,831,859.65 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：银华双动力债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	2,173,458.37
1.利息收入	2,667,848.54
其中：存款利息收入	424,997.42
债券利息收入	2,241,767.79
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,083.33
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-104,426.49
其中：股票投资收益	-24,118.00
基金投资收益	-
债券投资收益	-80,308.49
资产支持证券投资收益	-

贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-389,963.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.09
<b>减：二、费用</b>	<b>636,483.63</b>
1. 管理人报酬	430,332.96
2. 托管费	61,476.14
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	12,799.56
5. 利息支出	91,958.99
其中：卖出回购金融资产支出	91,958.99
6. 其他费用	39,915.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,536,974.74</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>1,536,974.74</b>

注：本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华双动力债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）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）	265,071,422.28	-	265,071,422.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,536,974.74	1,536,974.74
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	39,760,437.37	238,562.63	39,999,000.00

填列)			
其中：1.基金申购款	39,760,437.37	238,562.63	39,999,000.00
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	304,831,859.65	1,775,537.37	306,607,397.02

注：本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 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

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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.1.1 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 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.1.2 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。

#### 6.4.1.3 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。

#### 6.4.1.4 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。

## 6.4.1.5 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。

#### **6.4.1.6 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。

#### **6.4.1.7 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。

#### **6.4.1.8 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）”。

#### **6.4.1.9 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。

#### **6.4.1.10 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 0.70% 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 0.10% 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。

#### **6.4.1.11 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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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。

#### 6.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.2.3 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。

### 6.4.3 税项

#### (1) 印花税

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

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

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

#### (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

### (3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

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

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

## 6.4.4 关联方关系

### 6.4.4.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.4.2 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
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
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.5.1.1 股票交易**

注：本基金于 2016 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未通过关联方交易单元进行交易。

**6.4.5.2 关联方报酬****6.4.5.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	430,332.96
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

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

**6.4.5.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,476.14

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.5.3 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 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 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 2016 年 4 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.5.4.2 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。

#### 6.4.5.5 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 4 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	611,524.35	60,098.15

#### 6.4.5.6 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。

#### 6.4.5.7 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。

#### 6.4.6 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发流通受限的证券。

##### 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.6.3.1 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。

#### 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 60,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.7 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	9,583,912.26	2.61
	其中：股票	9,583,912.26	2.61
2	固定收益投资	309,689,573.40	84.28
	其中：债券	309,689,573.40	84.28
	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	2,018,448.34	0.55
7	其他各项资产	46,145,219.12	12.56
8	合计	367,437,153.12	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	1,322,581.26	0.43
C	制造业	4,681,444.00	1.53
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	898,350.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	2,681,537.00	0.87
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	9,583,912.26	3.13

### 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前十名股票投资明细

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	600409	三友化工	208,900	1,407,986.00	0.46
2	600794	保税科技	258,500	1,388,145.00	0.45
3	600160	巨化股份	126,600	1,345,758.00	0.44
4	002385	大北农	164,800	1,328,288.00	0.43

5	600029	南方航空	183,200	1,293,392.00	0.42
6	601088	中国神华	66,018	928,873.26	0.30
7	600755	厦门国贸	113,000	898,350.00	0.29
8	002241	歌尔股份	20,900	599,412.00	0.20
9	601898	中煤能源	76,300	393,708.00	0.13

注：本基金本报告期末仅持有以上股票。

## 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	002385	大北农	1,328,946.00	0.43
2	600794	保税科技	1,327,908.00	0.43
3	600409	三友化工	1,327,376.00	0.43
4	600029	南方航空	1,326,785.00	0.43
5	600160	巨化股份	1,322,789.00	0.43
6	601088	中国神华	931,710.80	0.30
7	600755	厦门国贸	918,048.00	0.30
8	002241	歌尔股份	608,857.00	0.20
9	601898	中煤能源	399,580.00	0.13
10	002589	瑞康医药	394,931.00	0.13

注：本基金本报告期内仅买入以上股票。

### 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	002589	瑞康医药	370,813.00	0.12

注：本基金本报告期内仅卖出以上股票。

### 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	9,886,930.80
卖出股票收入（成交）总额	370,813.00

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	19,896,000.00	6.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,995,000.00	3.26
	其中：政策性金融债	9,995,000.00	3.26
4	企业债券	238,926,573.40	77.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,872,000.00	13.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	309,689,573.40	101.01

## 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	124834	14 德城投	200,000	21,460,000.00	7.00
2	127192	15 沪闵行	200,000	21,434,000.00	6.99
3	1380232	13 滨州债	200,000	21,144,000.00	6.90
4	127246	15 徐州新盛债	200,000	20,988,000.00	6.85
5	101569010	15 赣出版 MTN002	200,000	20,774,000.00	6.78

## 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投资。

**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投资。

**7.10 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。

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1 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。**

**7.11.2 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。**

**7.11.3 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	22,367.38
2	应收证券清算款	571,488.66
3	应收股利	-
4	应收利息	5,552,363.08
5	应收申购款	39,999,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,145,219.12

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金于报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.11.6 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
228	1,336,981.84	304,750,839.53	99.97%	81,020.12	0.03%

### 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	29,110.11	0.01%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：截至本报告期末，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（2016 年 4 月 6 日）基金份额总额	265,071,422.28
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	39,760,437.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	304,831,859.65

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）北京分所。

### 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	
中信证券股份有限公司	1	7,554,196.80	73.64%	7,035.24	73.64%	-

光大证券股份 有限公司	1	1,937,803.00	18.89%	1,804.56	18.89%	-
兴业证券股份 有限公司	1	765,744.00	7.47%	713.12	7.46%	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
爱建证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏同信证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

3、本基金合同生效日为 2016 年 4 月 6 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
中信证券股份有限公司	256,293,372.38	100.00%	1,287,000,000.00	100.00%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

银华基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日