

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资 基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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 2017 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金		
基金简称	银华中证 800 等权指数增强分级		
场内简称	800 分级		
基金主代码	161825		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 11 月 5 日		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	49,579,881.12 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013 年 12 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	中证 800A	中证 800B	800 分级
下属分级基金的交易代码	150138	150139	161825
报告期末下属分级基金份额总额	2,932,616.00 份	2,932,616.00 份	43,714,649.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证 800 等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。</p>
投资策略	<p>本基金以中证 800 等权重指数为目标指数，在有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。</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 800 等权重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，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。</p> <p>本基金所持有的股票市值和买入、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%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，应当保持不低于基</p>

	金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。		
业绩比较基准	95%×中证 800 等权重指数收益率+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		银华基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-11,567,715.53	14,716,597.91	12,421,829.81
本期利润	-8,614,306.13	8,057,818.05	16,318,723.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1622	0.1040	0.2368
本期加权平均净值利润率	-16.26%	10.07%	23.17%
本期基金份额净值增长率	-14.49%	24.25%	39.65%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	6,967,192.07	16,854,459.64	12,414,738.18
期末可供分配基金份额利润	0.1405	0.3566	0.3811
期末基金资产净值	49,235,812.08	56,182,924.26	44,119,884.73
期末基金份额净值	0.993	1.189	1.354

3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	47.83%	72.87%	39.23%

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

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

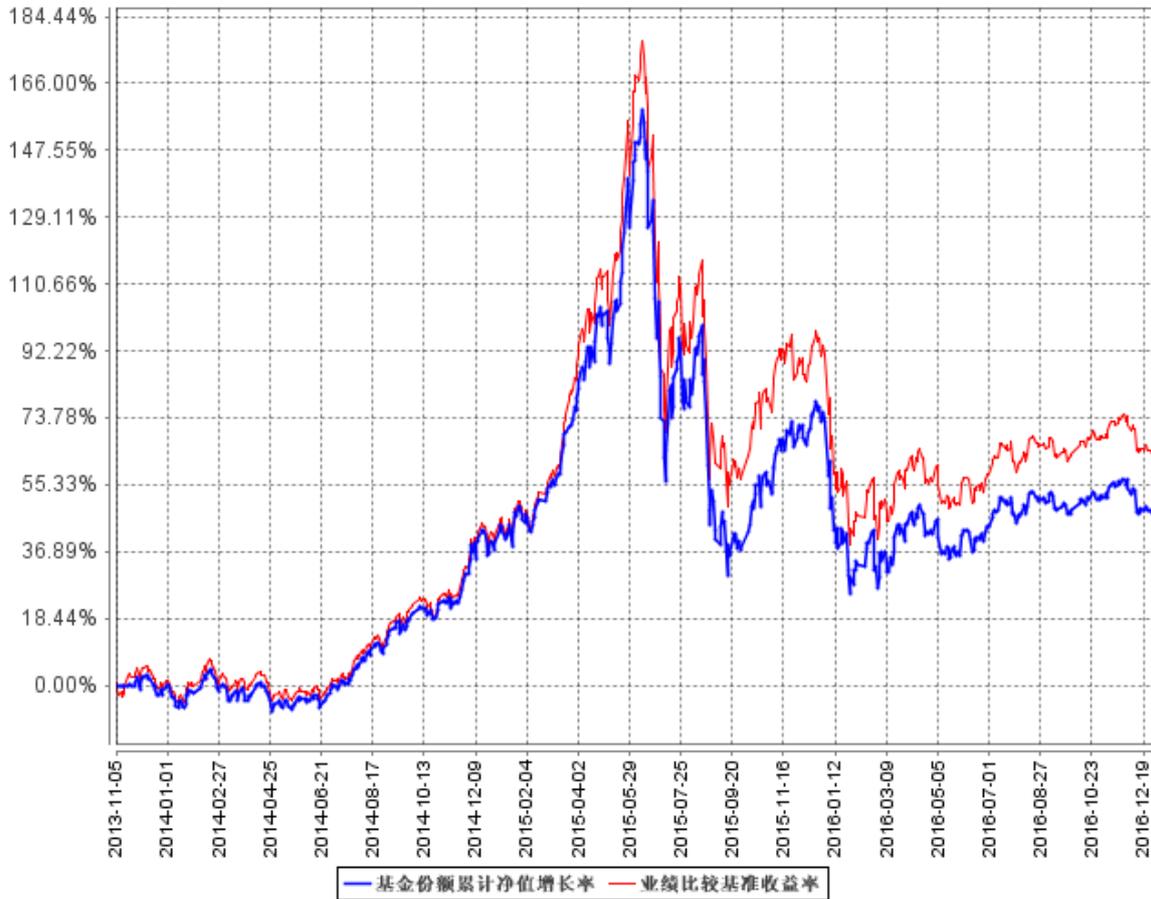
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.22%	0.76%	0.27%	0.77%	-0.49%	-0.01%
过去六个月	2.60%	0.82%	3.71%	0.85%	-1.11%	-0.03%
过去一年	-14.49%	1.69%	-14.19%	1.71%	-0.30%	-0.02%
过去三年	48.28%	1.85%	62.10%	1.90%	-13.82%	-0.05%
自基金合同生效起至今	47.83%	1.82%	64.20%	1.87%	-16.37%	-0.05%

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

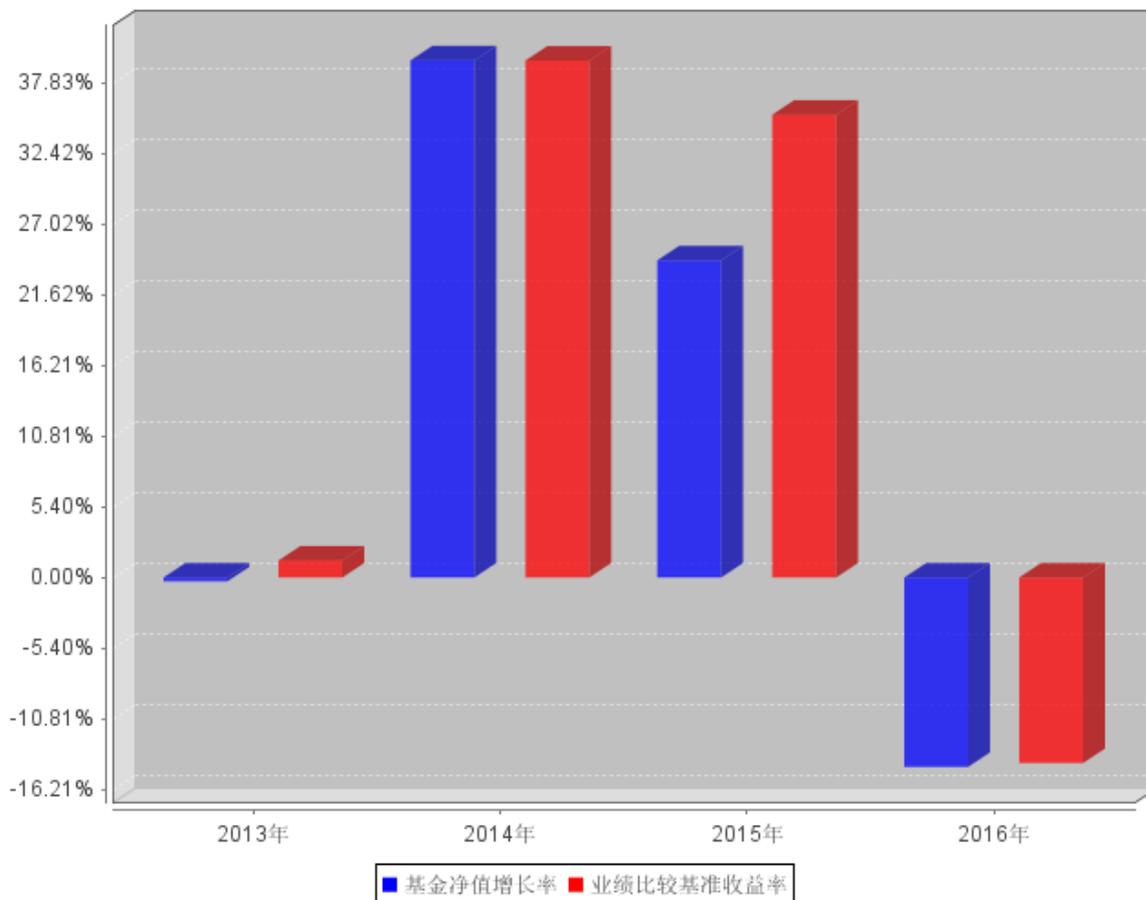
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、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%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

§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。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2016 年 12 月 31 日,本基金管理人管理着 70 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、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华

鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型证券投资基金。

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		
周毅先生	本基金的基金经理、公司副总经理、境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监	2013 年 11 月 5 日	-	17 年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，自 2010 年 5 月 7 日起担任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，2010 年 6 月 21 日至 2011 年 12 月 6 日期间兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2010 年 8 月 5 日至 2012 年 3 月 27 日期间兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，2010 年 12 月 6 日至 2012 年 11 月 7 日期间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：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013 年 11 月 5 日	-	7 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任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基金经理，自 2016 年 4 月 25 日起兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 800 等权重指数增强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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不掺杂任何的人为判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合

的名义下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

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

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

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

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

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

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用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、结构配比较验、风险优化等一系列事件。尽管报告期间本基金多次发生大额申购赎回，我们仍将跟踪误差控制在合理水平。

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 0.993 元，本报告期份额净值增长率为-14.49%，同期业绩比较基准收益率为-14.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的一年，A 股市场处于宽幅震荡中。尽管 PPP、金融地产、举牌概念等多种行业主题快速轮动，但仍缺乏能够持续引领市场的投资主线；上半年表现强势的食品饮料、有色金属等板块出现大幅度回调，而近年来强势的 TMT 板块今年以来持续低迷，整个季度市场整体表现偏弱。地产火爆对股市的分流、定向增发及 IPO 对资金的吸引、以及二级市场缺乏持续的赚钱效应，都使得 A 股的吸引力不断下降，成交量也不断萎缩。

展望 2017 年，全球及国内的各方面不确定性因素将逐步落地，资产价格的波动将会加大。供给侧改革、混合所有制改革等受政策驱动的主题和有确定性业绩的公司或存在阶段性的投资机会。在没有明确的投资主线出现之前，我们保持相对谨慎的投资观点。

本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标，期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

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

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 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，本基金存在连续二十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 2016 年 5 月 5 日至 2016 年 7 月 21 日。

§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”）在银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金 2016 年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,249,719.03	3,769,428.43
结算备付金	1,680.59	166,459.53
存出保证金	5,921.39	34,054.50
交易性金融资产	45,869,041.49	52,756,377.52
其中：股票投资	45,869,041.49	52,756,377.52
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	847.62	986.86
应收股利	-	-
应收申购款	13,004.40	2,007.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	50,140,214.52	56,729,314.43
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	153,953.67	-
应付赎回款	451,968.29	55,961.57
应付管理人报酬	42,658.30	48,254.11
应付托管费	8,531.68	9,650.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	50,613.20	37,324.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	196,677.30	395,199.14
负债合计	904,402.44	546,390.17
所有者权益：		
实收基金	33,305,188.79	32,512,781.88
未分配利润	15,930,623.29	23,670,142.38
所有者权益合计	49,235,812.08	56,182,924.26
负债和所有者权益总计	50,140,214.52	56,729,314.43

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，800 分级份额净值为人民币 0.993 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.004 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.982 元；基金份额总额为 49,579,881.12 份，其中 800 分级份额为 43,714,649.12 份，中证 800A 份额为 2,932,616.00 份，中证 800B 份额为 2,932,616.00 份。

7.2 利润表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-7,062,197.38	11,126,944.31
1.利息收入	36,406.06	89,360.23
其中：存款利息收入	36,212.05	89,360.23
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	194.01	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-10,100,302.33	17,081,448.03
其中：股票投资收益	-10,701,625.61	16,396,323.42
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	159,400.00	-
股利收益	441,923.28	685,124.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,953,409.40	-6,658,779.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	48,289.49	614,915.91
减：二、费用	1,552,108.75	3,069,126.26
1. 管理人报酬	531,102.84	784,297.32
2. 托管费	106,220.55	156,859.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	287,205.49	1,493,934.00
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	627,579.87	634,035.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-8,614,306.13	8,057,818.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-8,614,306.13	8,057,818.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,512,781.88	23,670,142.38	56,182,924.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,614,306.13	-8,614,306.13
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）	792,406.91	874,787.04	1,667,193.95

列)			
其中：1. 基金申购款	30,671,760.04	13,536,832.53	44,208,592.57
2. 基金赎回款	-29,879,353.13	-12,662,045.49	-42,541,398.62
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）	33,305,188.79	15,930,623.29	49,235,812.08
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,705,146.55	12,414,738.18	44,119,884.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,057,818.05	8,057,818.05
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）	807,635.33	3,197,586.15	4,005,221.48
其中：1. 基金申购款	267,527,713.49	233,380,637.59	500,908,351.08
2. 基金赎回款	-266,720,078.16	-230,183,051.44	-496,903,129.60
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）	32,512,781.88	23,670,142.38	56,182,924.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新	凌宇翔	龚飒
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]689 号《关于核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金募集的批复》的批准，由银华基金管理股份有限公司于 2013 年

10 月 9 日至 2013 年 10 月 30 日向社会公开募集。基金合同于 2013 年 11 月 5 日生效。首次设立募集规模为 458,328,703.92 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为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

基金份额包括银华中证 800 指数增强分级的基础份额（即“800 分级份额”）、银华中证 800 指数增强分级的稳健收益类份额（即“中证 800A 份额”）与银华中证 800 指数增强分级的积极收益类份额（即“中证 800B 份额”）。其中，中证 800A 份额、中证 800B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。银华中证 800 指数增强分级发售结束后，投资者场内认购的全部 800 分级份额将按 1:1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的中证 800A 份额和积极收益类的中证 800B 份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

在中证 800A 份额、800 分级份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，（第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日。）本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，中证 800A 份额和中证 800B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于中证 800A 份额期末的约定应得收益，即中证 800A 份额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 800 分级份额分配给中证 800A 份额持有人。800 分级份额持有人持有的每 2 份 800 分级份额将按 1 份中证 800A 份额获得新增 800 分级份额的分配。持有场外 800 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外 800 分级份额的分配；持有场内 800 分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内 800 分级份额的分配。经过上述份额折算，中证 800A 份额和 800 分级份额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 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上；当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元及以下。当 800 分级份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额的基金份额净值均调整为 1 元。当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和 800 分级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后银华 800 份额、中证 800A 份额和中证 800B 份额的基金份额

净值均调整为 1 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、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%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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相一致的说明

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相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.7.1 印花税

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

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

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

7.4.7.2 营业税、增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补

充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.7.3 企业所得税

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

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

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

7.4.7.4 个人所得税

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

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

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

全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
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
银华财富资本管理（北京）有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2016 年 8 月 9 日，银华基金管理有限公司变更名称为银华基金管理股份有限公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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交易。

7.4.8.1 关联方报酬

7.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	531,102.84	784,297.32
其中：支付销售机构的客户维护费	98,102.20	145,259.44

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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

7.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,220.55	156,859.42

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 0.20% 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

7.4.8.2 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与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日 (2013 年 11 月 5 日) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	16,837,524.19
期间申购/买入总份额	-	-	4,815,992.29
期间因拆分变动份额	-	-	516,200.45
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	22,169,716.93
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	50.71%

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日（ 2013 年 11 月 5 日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	16,721,571.91
期间因拆分变动份额	-	-	115,952.28
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	16,837,524.19
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	39.75%

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

7.4.8.3.2 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。

7.4.8.4 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,249,719.03	33,825.08	3,769,428.43	81,355.18

7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方 式	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中银国际证 券	601099	太平洋	配股	2,160	9,158.40

注：本基金上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	6,974	27,896.00	27,896.00	-

7.4.9.2 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
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	重大事项	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	26,752	192,420.72	198,767.36	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	重大事项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	8,920	195,442.48	189,104.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	10,532	67,689.43	78,779.36	-
000750	国海证券	2016 年 12 月 15 日	重大事项	6.97	2017 年 1 月 20 日	6.27	10,345	85,461.25	72,104.65	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项	25.20	-	-	2,769	64,782.95	69,778.80	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	重大事项	39.40	-	-	1,733	63,334.90	68,280.20	-
600649	城投控股	2016 年 12 月 6 日	重大事项	20.34	-	-	3,285	46,196.40	66,816.90	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大事项	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	2,548	59,871.09	66,095.12	-
601727	上海电气	2016 年 8 月 31 日	重大事项	8.42	-	-	7,669	88,967.51	64,572.98	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事项	7.29	-	-	8,684	57,439.53	63,306.36	-
300088	长信科技	2016 年 9 月	重大事项	15.80	-	-	3,969	54,250.67	62,710.20	-

		12 日								
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项	23.51	-	-	2,652	61,532.07	62,348.52	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大事项	18.92	-	-	3,236	70,966.76	61,225.12	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大事项	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	3,104	72,666.48	61,148.80	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事项	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	3,728	63,327.23	60,915.52	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项	10.97	-	-	5,420	61,661.04	59,457.40	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大事项	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	8,429	73,438.16	58,412.97	-
002745	木林森	2016 年 7 月 15 日	重大事项	36.49	-	-	1,600	58,408.32	58,384.00	-
603169	兰石重装	2016 年 11 月 24 日	重大事项	13.36	2017 年 3 月 21 日	14.32	4,303	62,709.73	57,488.08	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大事项	20.32	-	-	2,803	57,636.24	56,956.96	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	1,544	40,883.42	56,201.60	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	16,600	56,491.05	55,942.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项	13.79	-	-	4,027	61,877.01	55,532.33	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大事项	2.52	-	-	21,367	84,842.03	53,844.84	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	9.16	-	-	5,758	81,537.83	52,743.28	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大事项	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	3,200	50,254.00	52,544.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	3,397	83,790.16	52,177.92	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	4,123	84,995.70	51,537.50	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	2,600	52,212.28	48,932.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项	11.28	-	-	4,317	55,361.16	48,695.76	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	1,000	18,942.07	46,890.00	-
603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	重大事项	30.76	-	-	1,505	44,141.13	46,293.80	-

600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	重大事项	10.79	-	-	4,032	56,499.40	43,505.28	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 29 日	重大事项	16.63	-	-	2,440	41,212.17	40,577.20	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项	11.42	-	-	3,471	41,709.59	39,638.82	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大事项	16.28	-	-	2,413	46,921.11	39,283.64	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大事项	7.83	-	-	4,896	35,449.18	38,335.68	-
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	6,043	43,076.94	37,768.75	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	2,400	36,902.00	37,296.00	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	重大事项	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	2,647	43,047.30	37,190.35	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大事项	12.93	-	-	2,740	39,215.84	35,428.20	-
600654	中安消	2016 年 12 月 14 日	重大事项	17.43	-	-	2,000	34,950.00	34,860.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.60	-	-	2,347	55,759.18	34,266.20	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大事项	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	937	43,301.35	33,544.60	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大事项	26.80	-	-	1,192	42,693.04	31,945.60	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 43,199,516.84 元，属于第二层次的余额为人民币 2,669,524.65 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 48,270,244.65 元，第二层次人民币 4,486,132.87 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 2,083,609.15 元（2015 年度：人民币 1,950,322.78 元），由第二层次转入第一层次的金额为人民币 2,766,940.81 元（2015 年度：人民币 1,596,708.77 元）。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2015 年度：无）。

7.4.11.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.11.3 其他事项

于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 5 月 5 日至 2016 年 7 月 21 日。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.11.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,869,041.49	91.48
	其中：股票	45,869,041.49	91.48
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	4,251,399.62	8.48
7	其他各项资产	19,773.41	0.04
8	合计	50,140,214.52	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	332,154.33	0.67
B	采矿业	1,887,145.70	3.83
C	制造业	23,399,429.27	47.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,720,592.38	3.49
E	建筑业	1,769,836.20	3.59
F	批发和零售业	3,235,915.49	6.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,341,769.71	2.73
H	住宿和餐饮业	36,471.48	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,140,962.22	8.41
J	金融业	1,988,993.96	4.04
K	房地产业	2,877,108.49	5.84
L	租赁和商务服务业	750,615.26	1.52
M	科学研究和技术服务业	68,971.38	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	378,159.72	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	39,441.49	0.08
Q	卫生和社会工作	73,290.60	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,002,059.33	2.04
S	综合	624,958.02	1.27
	合计	45,667,875.03	92.75

8.2.2 期末积极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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	51,537.50	0.10

C	制造业	121,732.96	0.25
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	27,896.00	0.06
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	201,166.46	0.41

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	600537	亿晶光电	26,752	198,767.36	0.40
2	601231	环旭电子	18,300	195,993.00	0.40
3	000620	新华联	22,860	193,852.80	0.39
4	600586	金晶科技	41,860	193,811.80	0.39
5	601908	京运通	27,076	192,781.12	0.39
6	600801	华新水泥	24,828	192,417.00	0.39

7	002001	新 和 成	9,807	192,217.20	0.39
8	000631	顺发恒业	39,208	192,119.20	0.39
9	002238	天威视讯	13,046	191,123.90	0.39
10	600351	亚宝药业	19,327	190,950.76	0.39

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.yhfund.com.cn>) 的年度报告正文。

8.3.2 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前五名股票投资明细

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	000887	中鼎股份	2,548	66,095.12	0.13
2	601005	重庆钢铁	21,367	53,844.84	0.11
3	000693	ST 华泽	4,123	51,537.50	0.10
4	601375	中原证券	6,974	27,896.00	0.06
5	300003	乐普医疗	100	1,793.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述基金投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,280,809.80	2.28
2	600016	民生银行	799,965.00	1.42
3	601166	兴业银行	747,710.00	1.33
4	601398	工商银行	651,891.00	1.16
5	600036	招商银行	649,771.00	1.16
6	000002	万 科 A	641,628.00	1.14
7	601328	交通银行	534,868.00	0.95
8	600000	浦发银行	504,734.00	0.90
9	600030	中信证券	483,023.00	0.86
10	600837	海通证券	480,277.00	0.85
11	600519	贵州茅台	476,807.00	0.85
12	601288	农业银行	429,171.00	0.76
13	601169	北京银行	395,031.00	0.70
14	600823	世茂股份	371,512.00	0.66

15	601668	中国建筑	327,920.00	0.58
16	601601	中国太保	324,998.00	0.58
17	600373	中文传媒	323,726.00	0.58
18	601766	中国中车	298,106.00	0.53
19	600335	国机汽车	289,226.00	0.51
20	000333	美的集团	286,027.00	0.51

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。

8.4.2 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	601318	中国平安	1,303,601.00	2.32
2	600016	民生银行	786,081.00	1.40
3	601166	兴业银行	775,216.00	1.38
4	000002	万科A	690,676.00	1.23
5	600036	招商银行	677,869.17	1.21
6	601398	工商银行	677,647.00	1.21
7	600837	海通证券	579,083.00	1.03
8	600030	中信证券	566,988.79	1.01
9	601328	交通银行	551,124.00	0.98
10	600000	浦发银行	529,120.00	0.94
11	600519	贵州茅台	512,913.00	0.91
12	601288	农业银行	452,181.00	0.80
13	601169	北京银行	432,515.80	0.77
14	601668	中国建筑	380,039.00	0.68
15	601601	中国太保	357,404.00	0.64
16	000333	美的集团	341,920.00	0.61
17	000001	平安银行	317,823.00	0.57
18	601766	中国中车	308,266.00	0.55
19	600900	长江电力	293,899.00	0.52
20	601678	滨化股份	291,919.00	0.52

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,927,903.67
卖出股票收入（成交）总额	95,067,023.49

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,921.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	847.62
5	应收申购款	13,004.40
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,773.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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	600537	亿晶光电	198,767.36	0.40	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000887	中鼎股份	66,095.12	0.13	重大事项
2	601005	重庆钢铁	53,844.84	0.11	重大事项
3	000693	ST 华泽	51,537.50	0.10	重大事项
4	601375	中原证券	27,896.00	0.06	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中证 800A	133	22,049.74	882,576.00	30.10%	2,050,040.00	69.90%
中证 800B	679	4,319.02	0.00	0.00%	2,932,616.00	100.00%
800 分级	1,734	25,210.29	22,170,123.93	50.72%	21,544,525.19	49.28%
合计	2,546	19,473.64	23,052,699.93	46.50%	26,527,181.19	53.50%

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

中证 800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	太平资管—建设银行—太平资产乾坤 10 号资管产品	922,700.00	31.45%
2	李怡名	564,841.00	19.25%
3	王平	253,700.00	8.65%
4	郑志坤	240,744.00	8.20%
5	陶玲	120,555.00	4.11%
6	梁小红	103,788.00	3.54%
7	上海明沘投资管理有限公司—明沘 CTA 一号基金	100,000.00	3.41%
8	李小平	85,835.00	2.93%
9	张维琴	78,700.00	2.68%
10	胡葛芳	71,718.00	2.44%

中证 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	田蕴	161,100.00	5.49%
2	杨成英	144,600.00	4.93%
3	赵红军	106,555.00	3.63%
4	李明华	102,017.00	3.48%
5	王玉印	94,940.00	3.24%
6	满学瑞	78,087.00	2.66%
7	罗志军	71,958.00	2.45%
8	屈晓东	67,700.00	2.31%
9	顾耀国	62,000.00	2.11%
10	查刚	60,500.00	2.06%

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中证 800A	0.00	0.00%
	中证 800B	0.00	0.00%
	800 分级	228,834.86	0.52%
	合计	228,834.86	0.46%

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，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

9.4 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日（2013 年 11 月 5 日）基金份额总额	-	-	458,328,703.92
本报告期期初基金份额总额	2,454,261.00	2,454,261.00	42,357,391.79
本报告期基金总申购份额	-	-	44,615,052.99
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	43,459,082.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	478,355.00	478,355.00	201,287.15
本报告期末基金份额总额	2,932,616.00	2,932,616.00	43,714,649.12

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2016 年 9 月 3 日发布公告，经银华基金管理有限公司 2016 年第 1 次临时股东大会审议通过，选举李福春先生、常忠先生担任银华基金管理有限公司第六届董事会董事。经银华基金管理有限公司董事会、股东会审议通过，深圳市市场监督管理局核准，银华基金管理有限公司变更为“银华基金管理股份有限公司”。经银华基金管理股份有限公司创立大会暨 2016 年第一次股东大会审议通过，选举王珠林先生、钱龙海先生、李福春先生、吴坚先生、郑秉文先生、刘星先生、邢冬梅女士、封和平先生、王立新先生为本公司第一届董事会董事。其中，吴坚先生为新任董事，邢冬梅女士、封和平先生为新任独立董事。常忠先生不再继续担任本公司董事。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已为本基金连续提供了 3 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	4	190,877,477.57	100.00%	174,897.40	100.00%	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券股份有限公司	-	-	2,700,000.00	100.00%	-	-
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
国盛证券有限 责任公司						
中国银河证券 股份有限公司						
申万宏源集团 股份有限公司						
国信证券股份 有限公司						
国元证券股份 有限公司						
渤海证券股份 有限公司						
中信建投证券 股份有限公司						
国海证券股份 有限公司						
国开证券有限 责任公司						
平安证券有限 责任公司						
中信证券股份 有限公司						
北京高华证券 有限责任公司						
招商证券股份 有限公司						
西南证券股份 有限公司						
首创证券有限 责任公司						
川财证券有限 责任公司						
大同证券有限 责任公司						
华融证券股份 有限公司						
华创证券有限 责任公司						
华西证券股份 有限公司						
华鑫证券有限 责任公司						
联讯证券股份						

有限公司						
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易及权证交易。

银华基金管理股份有限公司
2017 年 3 月 31 日