

上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2017年半年度报告

2017年6月30日

基金管理人：上银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017年8月28日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月25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2017年3月9日(基金合同生效日)起至2017年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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情况	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	48
§11	影响投资者决策的其他重要信息	50
§12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	上银鑫达灵活配置
基金主代码	004138
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月9日
基金管理人	上银基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	373,355,991.70份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用股票与债券等资产配置策略，充分挖掘和利用各大类资产潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略包括类别资产配置策略、股票精选策略、折价与套利策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。

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	上银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	史振生	张志永
	联系电话	021-60232766	021-62677777-212004
	电子邮箱	zhensheng.shi@boscam.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话	021-60231999	95561	
传真	021-60231999	021-62159217	

注册地址	上海市浦东新区秀浦路2388号 3幢528室	福州市湖东路154号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1528 号陆家嘴基金大厦9层	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码	200122	20041
法定代表人	胡友联	高建平

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》、《中国证券报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.boscam.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上银基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦9层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年3月9日（基金合同生效日）-2017年6月30日）
本期已实现收益	-543,080.66
本期利润	1,732,307.79
加权平均基金份额本期利润	0.0045
本期加权平均净值利润率	0.45%
本期基金份额净值增长率	0.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)

期末可供分配利润	-811,027.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0022
期末基金资产净值	375,136,802.42
期末基金份额净值	1.0048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.48%

注：1、本基金基金合同生效日为2017年3月9日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未
满一年。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现孰低数（为期末余额，
不是当期发生数）。

4、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平
要低于所列数字。

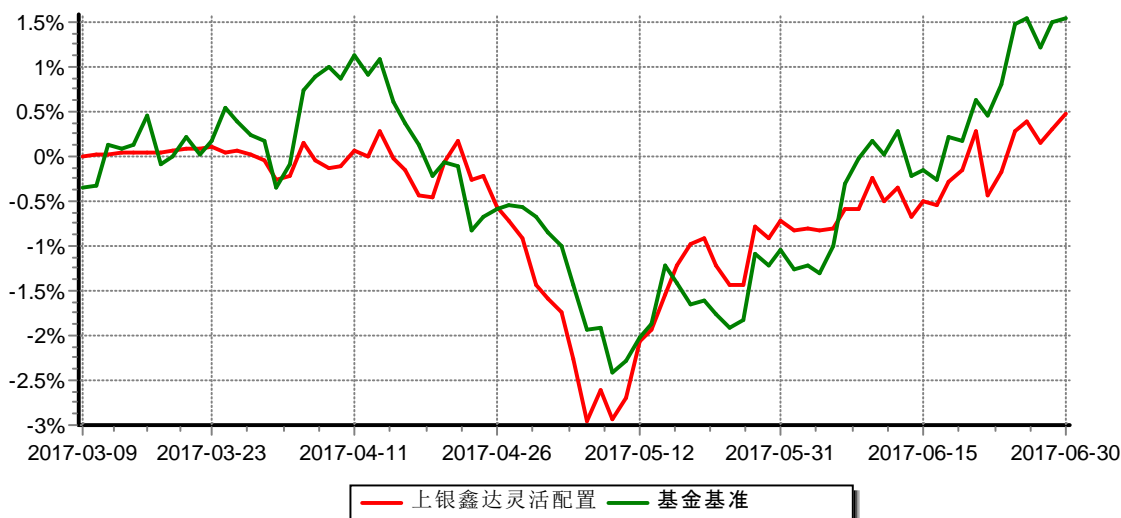
3.2 基金净值表现

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	1.20%	0.27%	2.61%	0.31%	-1.41%	-0.04%
过去三个月	0.70%	0.30%	1.63%	0.33%	-0.93%	-0.03%
自基金合同生效日起 至今（2017年03月09 日-2017年06月30日）	0.48%	0.27%	1.53%	0.32%	-1.05%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

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



注：本基金合同生效日为2017年3月9日，建仓期为2017年3月9日至2017年9月8日，目前本基金仍处于建仓期；截至本报告期末，基金合同生效不满一年。

§ 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

上银基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2013年8月30日正式成立。公司由上海银行股份有限公司与中国机械工业集团有限公司出资设立，注册资本为3亿元人民币，注册地上海。截至2017年6月30日，公司管理的基金共有六只，均为开放式基金，分别是：上银新兴价值成长混合型证券投资基金、上银慧财宝货币市场基金、上银慧添利债券型证券投资基金、上银慧盈利货币市场基金、上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金、上银慧增利货币市场基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵治焯	本基金基金经理、投资研究部副总监	2017年3月9日	—	6年	2011年7月至2014年2月担任中国银河证券北京中关村大街营业部理财分析师，2014年3月加入上银基金管理有限公司，担任投资研究部总监助理职务，

					2015年5月担任上银新兴价值成长股票型证券投资基金基金经理、投资研究部副总监,2017年3月担任上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部的《公平交易管理制度》，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的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，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2017年上半年，市场整体呈震荡上行的趋势，但市场分化严重，业绩确定性强、低估值蓝筹股呈大幅上行的态势，以壳价值作为市场底线的高估值中小市值成长股持续表现疲软。从市场行情来看，考虑到场内资金存量博弈、IPO持续发行、市场风险偏好难出现大幅好转的背景下，市场对于蓝筹股的价值重估将会持续。而在重组审核趋紧的背景下，以转型为核心的中小市值公司短期难有起色。因此，2017年上半年我们维持了均衡投资的思路，配置了盈利能力强，产业竞争优势明显的细分行业龙头。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为0.48%，同期业绩比较基准增长率为1.53%，基金投资收益低于同期业绩比较基准。

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，在十九大召开之前，A股市场将呈现稳定向好的态势，指数将逐步震荡上行。伴随着全球各大主要金融中心的货币逐步收紧，国内利率上行的趋势将会得到延续，但短期的悲观情绪预期得到修复。

2017年上半年，QFII对于优质行业龙头的配置明显加强，这也将引导国内资金持续流入业绩成长性较好的价值蓝筹股。供给方面来看，在市场平稳的局面下IPO发行速度有更好改善的趋势，这一趋势有望延续到下半年。

基于对市场整体及行业走势的判断，我们继续配置竞争格局清晰、优势凸显、可以不断提高市场份额的各细分行业龙头公司，维持“精选个股”的策略，挖掘消费领域中类似于新能源汽车等具备良好前景的子行业，以控制风险为前提，努力把握阶段性机会，持续为投资者创造长期价值。

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，本基金管理人严格按照本公司制订的《上银基金管理有限公司估值业务管理制度》、《上银基金管理有限公司估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括分管投资副总、督察长、分管运营总监、基金运营部负责人、基金会计代表、投资总监、基金经理或投资经理及监察稽核部代表等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无需实施利润分配。

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

本报告期内，本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万需要在本半年度报告中予以披露的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年6月30日
资 产:		
银行存款	6.4.7.1	54,824,842.29
结算备付金		4,338,000.00
存出保证金		95,050.33
交易性金融资产	6.4.7.2	211,168,651.43
其中：股票投资		112,248,651.43
基金投资		—
债券投资		98,920,000.00
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	115,000,000.00
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	104,561.05
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		385,531,105.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		8,984,151.54
应付赎回款		656,818.34
应付管理人报酬		375,823.25

应付托管费		78,296.52
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	232,529.20
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	66,683.83
负债合计		10,394,302.68
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	373,355,991.70
未分配利润	6.4.7.10	1,780,810.72
所有者权益合计		375,136,802.42
负债和所有者权益总计		385,531,105.10

注：1、报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.0048元，基金份额总额373,355,991.70份。

2、本财务报表的实际编制期间为2017年3月9日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间，本基金运作时间未满一年。

6.2 利润表

会计主体：上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
一、收入		3,968,554.99
1.利息收入		3,609,126.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,525,284.05
债券利息收入		112,128.26
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		971,713.99

其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,957,410.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,704,226.69
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13.1	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	—
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	746,816.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,275,388.45
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	41,450.45
减：二、费用		2,236,247.20
1. 管理人报酬		1,433,082.15
2. 托管费		298,558.82
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.19	438,307.65
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	66,298.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,732,307.79
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,732,307.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017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)	389,963,218.46	—	389,963,218.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	1,732,307.79	1,732,307.79
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)	-16,607,226.76	48,502.93	-16,558,723.83
其中：1.基金申购款	20,803.59	6.33	20,809.92
2.基金赎回款	-16,628,030.35	48,496.60	-16,579,533.75
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)	373,355,991.70	1,780,810.72	375,136,802.42

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：

李永飞

栾卉燕

金雯澜

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

上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证监会《关于准予上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1202号)和2016年12月8日中国证监会证券投资基金机构监管部《关于上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函【2016】3126号)进行募集,由上银基金管理有限公司依照《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》等

相关法律法规及《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》发售，基金合同于2017年3月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为389,963,218.46份基金份额。本基金的基金管理人为上银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《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》等相关法律法规及《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的0%-95%；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%；权证投资占基金资产净值的0-3%。对于法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他金融工具，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： $50\% \times \text{中证800指数收益率} + 50\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况、自2017年3月9日(基金合同生效日)至2017年6月30日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

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际

利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易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，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,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,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%,若《基金合同》生效不满3个月可不进

行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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。本基金每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告 [2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字 [2007] 21号《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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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》、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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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 [2008]1号文《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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》、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》、财税[2017] 56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2015] 125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 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(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

自2018年1月1日(含)以后, 资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务), 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税; 管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为(以下称其他业务), 按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的, 资管产品运营业务不得适用简易计税办法。

对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。截至2017年6月30日, 本基金没有计提增值税。

(d) 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、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、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。自2013年1月1日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 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, 股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的, 暂减按25%计入应纳税所得额, 股权登记日在2015年9月8日及以后的, 暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得, 暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益, 由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时, 对香港市场投资者按照10%的税率代扣

所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2017年6月30日
活期存款	54,824,842.29
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	54,824,842.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	110,039,462.98	112,248,651.43	2,209,188.45
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	98,853,800.00	98,920,000.00

	合计	98,853,800.00	98,920,000.00	66,200.00
	资产支持证券	—	—	—
	基金	—	—	—
	其他	—	—	—
	合计	208,893,262.98	211,168,651.43	2,275,388.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	115,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	115,000,000.00	—

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	30,138.27
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	1,952.10
应收债券利息	112,128.26
应收买入返售证券利息	-39,700.28
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	42.70

合计	104,561.05
----	------------

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	232,529.20
银行间市场应付交易费用	—
合计	232,529.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,650.25
预提费用	65,033.58
合计	66,683.83

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	389,963,218.46	389,963,218.46
本期申购	20,803.59	20,803.59
本期赎回(以“-”号填列)	-16,628,030.35	-16,628,030.35
本期末	373,355,991.70	373,355,991.70

注：1、本基金自2017年2月3日至2017年3月7日止期间公开发售，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币389,906,375.05元。根据《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，在募集期间产生的活期存款利息为人民币56,843.41元，折算为56,843.41份基金份额。以上

实收基金（本息）合计为人民币389,963,218.46元，折合389,963,218.46份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2017年3月9日（基金合同生效日）至2017年6月8日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2017年6月9日起开始办理。转换及定期定额业务自2017年6月22日开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-543,080.66	2,275,388.45	1,732,307.79
本期基金份额交易产生的变动数	-267,946.75	316,449.68	48,502.93
其中：基金申购款	304.21	-297.88	6.33
基金赎回款	-268,250.96	316,747.56	48,496.60
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-811,027.41	2,591,838.13	1,780,810.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
活期存款利息收入	274,365.35
定期存款利息收入	2,234,722.22
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	15,967.49
其他	228.99
合计	2,525,284.05

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票	-2,704,226.69

差价收入	
股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	-2,704,226.69

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
卖出股票成交总额	147,035,448.65
减：卖出股票成本总额	149,739,675.34
买卖股票差价收入	-2,704,226.69

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	746,816.48
基金投资产生的股利收益	—
合计	746,816.48

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
1.交易性金融资产	2,275,388.45
——股票投资	2,209,188.45
——债券投资	66,200.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	2,275,388.45

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
基金赎回费收入	41,450.45
合计	41,450.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
交易所市场交易费用	438,307.65
银行间市场交易费用	—
合计	438,307.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
审计费用	22,952.76
信息披露费	42,080.82
其他	400.00
汇划手续费	865.00
合计	66,298.58

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上银基金管理有限公司("上银基金")	基金管理人、基金直销机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金代销机构
上海银行股份有限公司("上海银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
上银瑞金资本管理有限公司("上银瑞金")	基金管理人出资成立的子公司
上海骏连投资管理有限公司("上海骏连")	基金管理人的全资孙公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金自2017年3月9日(基金合同生效日)至2017年6月30日止期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,433,082.15
其中：支付销售机构的客户维护费	451,754.56

注：支付基金管理人上银基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	298,558.82

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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

本基金自2017年3月9日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间无通过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

份额单位：份

项目	本期
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日
基金合同生效日(2017年3月9日)持有的基金份额	49,999,000.00

期初持有的基金份额	49,999,000.00
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	49,999,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	13.39%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.4.10.4 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

本报告期末本基金除基金管理人之外的其他关联方不存在投资本基金的情况。

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	
	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行活期存款	54,824,842.29	274,365.35

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017年3月9日(基金合同生效日)至2017年6月30日止期间获得的利息收入为人民币15,967.49元，2017年6月30日结算备付金余额为人民币4,338,000.00元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自2017年3月9日(基金合同生效日)至2017年6月30日止期间无通过关联方购买其承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未向全体份额持有人实施利润分配。

6.4.12 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相

应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及其下属风险管理人员负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日
A-1	—
A-1以下	—
未评级	98,920,000.00
合计	98,920,000.00

注：未评级债券为银行间同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金

的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价

值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	54,824,842.29	—	—	—	—	—	54,824,842.29
结算备付金	4,338,000.00	—	—	—	—	—	4,338,000.00
存出保证金	95,050.33	—	—	—	—	—	95,050.33
交易性金融资产	—	98,920,000.00	—	—	—	112,248,651.43	211,168,651.43
买入返售金融资产	115,000,000.00	—	—	—	—	—	115,000,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	104,561.05	104,561.05
资产总计	174,257,892.62	98,920,000.00	—	—	—	112,353,212.48	385,531,105.10
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	8,984,151.54	8,984,151.54
应付赎回款	—	—	—	—	—	656,818.34	656,818.34
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	375,823.25	375,823.25
应付托管费	—	—	—	—	—	78,296.52	78,296.52
应付交易费用	—	—	—	—	—	232,529.20	232,529.20
其他负债	—	—	—	—	—	66,683.83	66,683.83

负债总计	—	—	—	—	—	10,394,302.68	10,394,302.68
利率敏感度缺口	174,257,892.62	98,920,000.00	—	—	—	101,958,909.80	375,136,802.42

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金持有少量银行间同业存单，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生的波动风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持有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。本基金通过资产优化配置降低股票市场价格风险。此外，本基金管理人定期运用多种定量方法进行风险度量和分析。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	112,248,651.43	29.92
交易性金融资产-债券投资	98,920,000.00	26.37
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	211,168,651.43	56.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变
假设	本基金持有的股票的涨跌幅与业绩比较基准中的股票指数的涨跌幅一致

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2017年6月30日
	业绩比较基准上升5%	5,612,432.57
	业绩比较基准下降5%	-5,612,432.57

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2017年6月30日，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中属于第一层级的余额为112,199,077.64元，属于第二层级的余额为49,573.79元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	112,248,651.43	29.12
	其中：股票	112,248,651.43	29.12
2	固定收益投资	98,920,000.00	25.66
	其中：债券	98,920,000.00	25.66
	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	115,000,000.00	29.83
	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	59,162,842.29	15.35
7	其他资产	199,611.38	0.05
8	合计	385,531,105.10	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 报告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	—	—
C	制造业	68,183,901.55	18.18
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	3,973,018.00	1.06
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	27,667,131.88	7.38
K	房地产业	12,424,600.00	3.31
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	112,248,651.43	29.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	2,030,828	22,765,581.88	6.07
2	000333	美的集团	353,900	15,231,856.00	4.06
3	600388	龙净环保	931,700	14,469,301.00	3.86
4	600340	华夏幸福	370,000	12,424,600.00	3.31
5	600066	宇通客车	506,646	11,131,012.62	2.97
6	002372	伟星新材	517,700	9,670,636.00	2.58
7	300477	合纵科技	492,300	9,235,548.00	2.46
8	600036	招商银行	205,000	4,901,550.00	1.31

9	600519	贵州茅台	10,000	4,718,500.00	1.26
10	000963	华东医药	79,940	3,973,018.00	1.06
11	002043	兔宝宝	250,000	3,460,000.00	0.92
12	603801	志邦申购	1,406	47,522.80	0.01
13	603043	酒家申购	1,810	45,738.70	0.01
14	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
15	603335	迪生申购	2,230	24,864.50	0.01
16	603679	华体申购	809	21,438.50	0.01
17	603938	三孚申购	1,246	20,932.80	0.01
18	603933	睿能申购	857	17,311.40	—
19	603305	旭升申购	1,351	15,212.26	—
20	603286	日盈申购	890	13,528.00	—
21	603331	百达申购	999	9,620.37	—
22	603617	君禾申购	832	7,429.76	—

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	601009	南京银行	38,318,248.76	10.21
2	600240	华业资本	34,955,876.53	9.32
3	000039	中集集团	34,704,994.32	9.25
4	000858	五粮液	24,735,665.00	6.59
5	300477	合纵科技	20,524,245.00	5.47
6	000333	美的集团	14,006,605.00	3.73
7	600388	龙净环保	13,968,020.70	3.72
8	600340	华夏幸福	12,983,571.00	3.46
9	002071	长城影视	12,705,389.03	3.39
10	000725	京东方A	12,054,170.00	3.21
11	600066	宇通客车	11,133,426.04	2.97

12	002372	伟星新材	8,772,810.00	2.34
13	600519	贵州茅台	4,670,371.64	1.24
14	600036	招商银行	4,328,164.00	1.15
15	300571	平治信息	3,907,902.35	1.04
16	000963	华东医药	3,895,212.80	1.04
17	002043	兔宝宝	3,437,759.00	0.92
18	601952	苏垦农发	97,161.00	0.03
19	601878	浙商申购	93,364.05	0.02
20	603980	吉华申购	59,322.80	0.02

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值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	000039	中集集团	34,741,330.74	9.26
2	000858	五粮液	28,538,598.00	7.61
3	600240	华业资本	28,153,872.33	7.50
4	601009	南京银行	13,589,447.00	3.62
5	002071	长城影视	12,415,601.28	3.31
6	300477	合纵科技	12,380,097.00	3.30
7	000725	京东方A	12,123,000.00	3.23
8	300571	平治信息	3,865,750.63	1.03
9	601952	苏垦农发	198,179.25	0.05
10	601878	浙商申购	190,484.76	0.05
11	603980	吉华申购	108,707.99	0.03
12	300660	江苏雷利	92,424.20	0.02
13	603197	保隆科技	59,892.90	0.02
14	603855	华荣股份	50,468.00	0.01
15	603767	中马申购	46,302.90	0.01

16	603196	日播时尚	45,512.52	0.01
17	603383	顶点软件	44,037.30	0.01
18	300662	科锐国际	43,056.00	0.01
19	603042	华脉科技	41,321.28	0.01
20	002877	智能自控	40,208.00	0.01

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	259,779,138.32
卖出股票的收入（成交）总额	147,035,448.65

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	98,920,000.00	26.37
9	其他	—	—
10	合计	98,920,000.00	26.37

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资
---	------	------	-------	------	------

号					产净值比例(%)
1	111717129	17光大银行CD129	1,000,000	98,920,000.00	26.37

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

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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报告期内没有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中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	95,050.33
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—

4	应收利息	104,561.05
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	199,611.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。基金份额持有人如欲了解本基金投资组合的其他相关信息，可致电本基金管理人获取。

§ 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
3,833	97,405.69	49,999,000.00	13.39%	323,356,991.70	86.61%

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	10,363,036.58	2.78%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10^50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年3月9日)基金份额总额	389,963,218.46
基金合同生效日基金份额总额	389,963,218.46
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	20,803.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	16,628,030.35
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	373,355,991.70

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人重大人事变动：

报告期内基金管理人通过二届董事会第六次会议聘任史振生先生为督察长、汪天光先生为副总经理；二届董事会第七次会议同意王素文先生辞去公司副总经理一职，王素文先生将全职担任子公司上银瑞金资本管理有限公司总经理职务。

上述人员的变更已报中国证券监督管理委员会及上海监管局备案。

报告期内基金经理变动情况如下：

谢新先生任上银慧添利债券型证券投资基金基金经理，与楼昕宇先生共同管理该基金。

赵治焯先生任上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

楼昕宇先生任上银慧增利货币市场基金基金经理。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	5,962,789.59	1.47%	4,360.97	1.71%	—
中泰证券	2	400,176,006.23	98.53%	250,886.62	98.29%	—

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司管理层批准。

2、本报告期内，本基金本报告期内新增天风证券交易单元。

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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
天风证券	—	—	115,000,000	1.95%	—	—
中泰证券	—	—	5,784,900,000	98.05%	—	—

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	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《中国证券报》	2017-01-24
2	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金合同	基金管理人公司网站	2017-01-24
3	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金合同摘要	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《中国证券报》	2017-01-24
4	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议	基金管理人公司网站	2017-01-24
5	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《中国证券报》	2017-01-24
6	上银基金管理有限公司关于新增上海万得投资顾问有限公司为旗下相关基金代销机构及参加费率优惠活动的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-02-20
7	上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-03-08
8	上银鑫达灵活配置混合型证券投资	基金管理人公司网站、	2017-03-10

	资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	
9	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-03-20
10	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-03-24
11	上银基金管理有限公司关于新增兴业银行直销资金账户的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-04-25
12	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-06
13	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金参加上海陆金所资产管理有限公司申购费率优惠活动的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-10
14	上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金开通转换、定期定额投资业务的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-22
15	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-23
16	上银基金管理有限公司关于高级管理人员离任的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-24
17	上银基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券日报》、《中证报》	2017-06-28
18	上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券	2017-06-29

		日报》、《中证报》	
19	旗下基金2017年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	基金管理人公司网站	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.boscam.com.cn)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人上银基金管理有限公司。

客户服务中心电话: 021-60231999

上银基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日