

银华回报灵活配置定期开放混合型发起式  
证券投资基金  
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人宁波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 2017 年 1 月 1 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	银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	银华回报灵活配置定期开放混合发起式
基金主代码	000904
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 12 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	528,350,274.60 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，同时通过优化风险收益配比来追求绝对收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题投资”这个核心理念。深入分析挖掘社会经济发展进程中各类投资主题得以产生和持续的内在驱动因素，重点投资于具有可持续发展前景的投资主题中的优质上市公司。
业绩比较基准	年化收益率 5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

### 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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	贺碧波
	联系电话	(010)58163000	(0574)89103198
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	hebibo@nbcb.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95574
传真		(010)58163027	(0574)89103213

## 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	6,974,261.97
本期利润	2,974,111.66
加权平均基金份额本期利润	0.0046
本期加权平均净值利润率	0.50%
本期基金份额净值增长率	0.43%
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	-71,952,596.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1362
期末基金资产净值	494,025,282.57
期末基金份额净值	0.935
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	19.97%

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

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

#### 3.2 基金净值表现

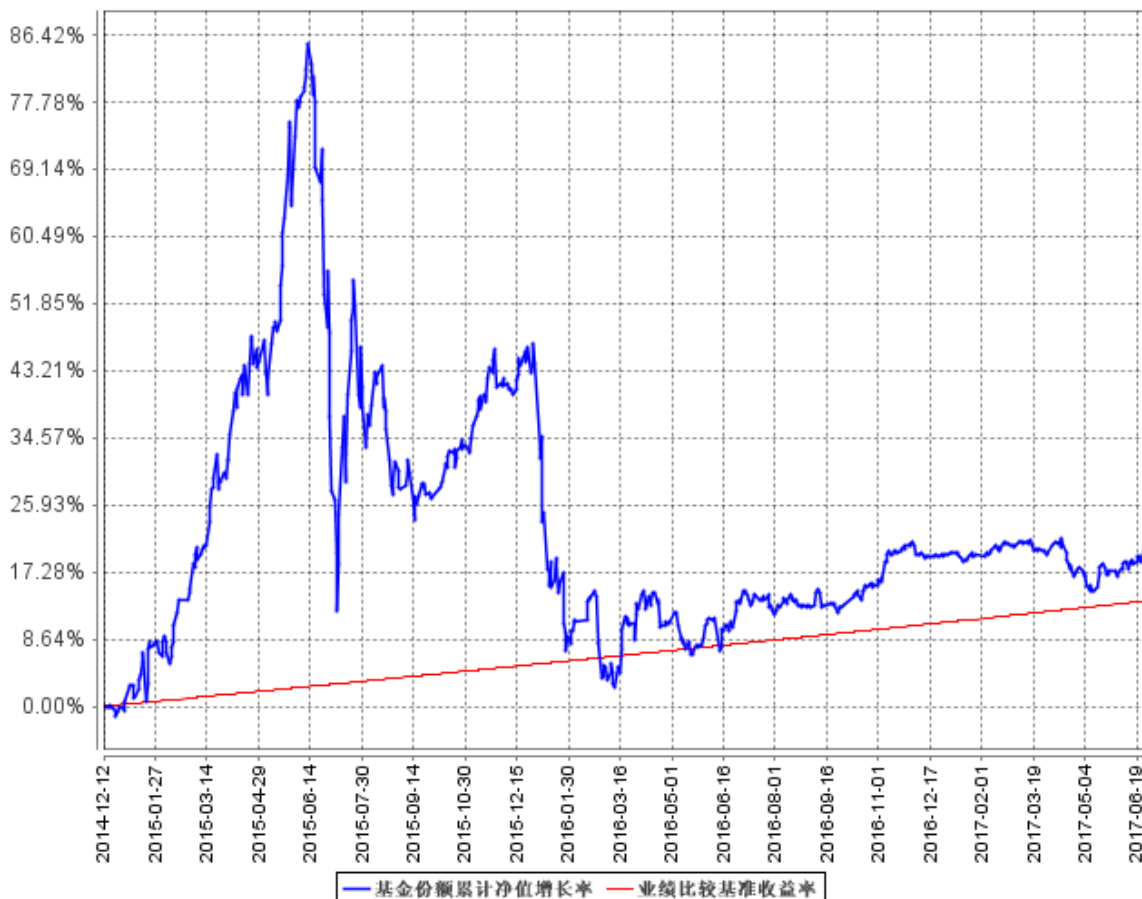
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.19%	0.49%	0.41%	0.01%	1.78%	0.48%
过去三个月	0.32%	0.55%	1.25%	0.01%	-0.93%	0.54%
过去六个月	0.43%	0.42%	2.51%	0.02%	-2.08%	0.40%
过去一年	5.53%	0.45%	5.13%	0.02%	0.40%	0.43%
自基金合同生效起至今	19.97%	1.63%	13.62%	0.02%	6.35%	1.61%

注：本基金业绩比较基准为：年化收益率 5%。本基金追求绝对收益，因此以年化收益率 5%作为本基金的业绩比较基准能够比较准确地体现本基金的投资目标。

### 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，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 79 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、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发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王斌先生	本基金的基金经理	2016 年 2 月 6 日	-	9.5 年	学士学位；2007 年至 2010 年任职中国国际金融有限公司研究部。2011 年加盟银华基金管理有限公司，历任研究员及研究主管，曾任基金经理助理，2016 年 2 月 6 日至 2017 年 6 月 8 日兼任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、《银华回报灵活配置定期开放混合型发起式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

上半年市场在总体低波动的格局下出现剧烈结构分化，去年年末市场关注的核心问题经济增长及汇率的走向皆好于预期，且为行情走势贡献不小向上弹性，综合而言消费白马以及周期板块表现最为突出。回报基金上半年对市场主线的把握力度有所不足，逆向投资的思路影响了我们对于有明显获利板块下注的力度，但随着近期市场活跃度的提升，我们此前以绝对收益思路布局的部分标的已经开始有所表现。

##### 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 0.935 元，本报告期份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 2.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，主导市场波动的重要因素在于金融去杠杆，一季度中国经济起步较好，未来几个季度经济在不出现明显失速的前提下，应该假设这一监管操作可能在较长的时间中以适当的方式持续下去。监管和经济韧性的平衡为市场孕育较有性价比的操作机会提供了条件，在前期经济活跃度有所恢复的结构上，消费升级、平稳外部环境、包括纳入 MSCI 在内的资本市场开放等因素的共振造就了二季度市场的主线，而历史数据显示，低波动率的市场特性有较大的概率会将既有趋势继续延续下去，除非出现明显的宏观变量冲击。市场仍在可为区间，我们将在理解当下市场运行特点的前提下，继续坚持以逆向投资为主的思路，控制好回撤，提高灵活性，谋求绝对收益。

#### 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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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（2017 年上半年），本托管人在《银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金》的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内（2017 年上半年），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，对本基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配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损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内（2017 年上半年），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。其中第六节 6.4.10.1.1 基金管理费中支付销售机构的客户维护费、第八节基金份额持有人信息以管理人数据为准。

## §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：银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	38,653,582.61	35,274,542.88
结算备付金	22,958,245.84	76,174,504.42
存出保证金	1,145,055.33	1,023,695.03
交易性金融资产	350,945,430.80	105,878,814.58
其中：股票投资	350,945,430.80	105,878,814.58
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	-	450,000,000.00
应收证券清算款	95,095,441.77	9,785,109.34
应收利息	-21,070.16	81,861.50
应收股利	-	-
应收申购款	1,322,456.18	47,111.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	510,099,142.37	678,265,639.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	29,727,712.79
应付赎回款	14,279,913.68	11,396,009.65
应付管理人报酬	462,424.84	571,163.97
应付托管费	115,606.23	142,790.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	931,287.84	1,051,439.38

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	284,627.21	206,915.57
负债合计	16,073,859.80	43,096,032.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	528,350,274.60	682,346,251.99
未分配利润	-34,324,992.03	-47,176,645.02
所有者权益合计	494,025,282.57	635,169,606.97
负债和所有者权益总计	510,099,142.37	678,265,639.31

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.935 元，基金份额总额 528,350,274.60 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	11,240,700.48	-275,364,383.34
1.利息收入	4,808,189.63	2,881,202.56
其中：存款利息收入	762,261.62	1,346,279.52
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	4,045,928.01	1,534,923.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	10,418,967.27	-198,965,403.57
其中：股票投资收益	9,455,788.48	-200,047,727.75
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	-	-520,585.00
股利收益	963,178.79	1,602,909.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,000,150.31	-79,591,207.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,693.89	311,025.66
<b>减：二、费用</b>	<b>8,266,588.82</b>	<b>11,694,088.39</b>
1. 管理人报酬	2,972,261.96	4,686,613.42
2. 托管费	743,065.55	1,171,653.38
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,357,864.62	5,641,889.67
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	193,396.69	193,931.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,974,111.66</b>	<b>-287,058,471.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,974,111.66</b>	<b>-287,058,471.73</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 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）	682,346,251.99	-47,176,645.02	635,169,606.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,974,111.66	2,974,111.66
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）	-153,995,977.39	9,877,541.33	-144,118,436.06
其中：1.基金申购款	1,977,738.26	-133,053.79	1,844,684.47
2. 基金赎回款	-155,973,715.65	10,010,595.12	-145,963,120.53
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	528,350,274.60	-34,324,992.03	494,025,282.57

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	(基金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,226,660,893.50	151,979,429.44	1,378,640,322.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-287,058,471.73	-287,058,471.73
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)	-393,406,161.28	40,009,541.34	-353,396,619.94
其中：1.基金申购款	11,031,954.75	71,934.92	11,103,889.67
2.基金赎回款	-404,438,116.03	39,937,606.42	-364,500,509.61
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)	833,254,732.22	-95,069,500.95	738,185,231.27

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 \_\_\_\_\_ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 重要会计政策和会计估计

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。

### 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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	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

注：本基金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。

##### 6.4.5.1 关联方报酬

###### 6.4.5.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	2,972,261.96	4,686,613.42

的管理费		
其中：支付销售机构的 客户维护费	920,291.11	1,123,202.73

注：1、基金基本管理费每日计提，按月支付。基金基本管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金基本管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金附加管理费条款详见基金合同。

#### 6.4.5.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	743,065.55	1,171,653.38

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.5.2 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债券(含回购)的交易。

#### 6.4.5.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.3.1 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2014年12月12日）持有的基金份额	10,000,550.05	10,000,550.05
期初持有的基金份额	10,000,550.05	10,000,550.05
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	10,000,550.05	10,000,550.05
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.89%	1.20%

注：本基金基金合同于 2014 年 12 月 12 日生效，截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,000,550.05 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 550.05 份。

#### 6.4.5.3.2 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：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未持有本基金份额。

#### 6.4.5.4 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	38,653,582.61	355,389.11	49,715,278.92	769,880.37

#### 6.4.5.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.5.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.6 期末（2017 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙	2017 年	2017	新股流	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

	羽	6 月 15 日	年 7 月 17 日	通受限							
603933	睿能 科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流 通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40		-
603305	旭升 股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流 通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26		-
300670	大烨 智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87		-
300672	国科 微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流 通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36		-
603331	百达 精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37		-
300671	富满 电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62		-

#### 6.4.6.2 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
600795	国电 电力	2017 年 6 月 5 日	重大 事项	3.60	-	-	1,033,969	3,587,165.11	3,722,288.40	-
002128	露 天 煤 业	2017 年 3 月 17 日	重大 事项	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	355,400	3,204,687.00	3,091,980.00	-

### 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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## §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	350,945,430.80	68.80
	其中：股票	350,945,430.80	68.80
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	61,611,828.45	12.08
7	其他各项资产	97,541,883.12	19.12
8	合计	510,099,142.37	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

### 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	12,565,123.68	2.54
C	制造业	151,831,591.73	30.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,683,713.72	8.03

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	37,041,914.00	7.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,648,194.42	7.01
J	金融业	187,943.49	0.04
K	房地产业	56,322,172.66	11.40
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	5,998,229.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	12,666,548.10	2.56
S	综合	-	-
	合计	350,945,430.80	71.04

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股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	000567	海德股份	1,307,007	34,217,443.26	6.93
2	600787	中储股份	3,954,600	31,280,886.00	6.33
3	300050	世纪鼎利	2,844,440	28,643,510.80	5.80
4	600027	华电国际	5,339,918	25,791,803.94	5.22
5	002466	天齐锂业	423,439	23,013,909.65	4.66
6	603808	歌力思	703,713	20,773,607.76	4.20
7	600779	水井坊	798,845	19,635,610.10	3.97
8	002831	裕同科技	211,069	15,830,175.00	3.20
9	002241	歌尔股份	747,150	14,405,052.00	2.92
10	300115	长盈精密	488,853	14,264,730.54	2.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票信息，应阅读登载于 <http://www.yhfund.com.cn> 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600027	华电国际	52,595,424.35	8.28
2	603808	歌力思	50,705,618.23	7.98
3	000100	TCL 集团	41,119,031.00	6.47
4	000567	海德股份	39,208,826.90	6.17
5	300021	大禹节水	37,578,375.39	5.92
6	600787	中储股份	34,422,019.69	5.42
7	300050	世纪鼎利	33,639,445.18	5.30
8	600795	国电电力	32,547,715.00	5.12
9	600000	浦发银行	31,719,380.15	4.99
10	600011	华能国际	31,511,350.89	4.96
11	000998	隆平高科	30,800,209.05	4.85
12	600583	海油工程	26,851,079.92	4.23
13	000669	金鸿能源	25,479,581.39	4.01
14	600737	中粮糖业	25,411,178.96	4.00
15	600584	长电科技	25,391,645.67	4.00
16	000959	首钢股份	24,065,117.76	3.79
17	600688	上海石化	23,744,230.00	3.74
18	601336	新华保险	22,401,786.18	3.53
19	600900	长江电力	20,380,293.21	3.21
20	601928	凤凰传媒	20,219,449.28	3.18
21	600779	水井坊	19,826,017.87	3.12
22	002466	天齐锂业	19,781,662.39	3.11
23	600884	杉杉股份	19,197,084.69	3.02
24	600123	兰花科创	19,038,051.87	3.00
25	002640	跨境通	19,037,442.54	3.00
26	600887	伊利股份	18,392,364.00	2.90
27	601333	广深铁路	17,062,470.69	2.69
28	300115	长盈精密	17,024,624.03	2.68
29	600886	国投电力	16,748,433.00	2.64
30	300140	启源装备	16,539,329.77	2.60



31	600977	中国电影	16,178,135.57	2.55
32	600109	国金证券	15,994,321.00	2.52
33	002831	裕同科技	15,329,675.78	2.41
34	603223	恒通股份	14,700,823.92	2.31
35	601668	中国建筑	14,268,712.00	2.25
36	000002	万科A	14,190,560.82	2.23
37	601222	林洋能源	14,150,116.48	2.23
38	002241	歌尔股份	13,604,667.77	2.14
39	300332	天壕环境	13,500,738.54	2.13
40	601166	兴业银行	13,399,284.00	2.11
41	600030	中信证券	12,795,690.91	2.01
42	600028	中国石化	12,793,696.00	2.01
43	000728	国元证券	12,781,430.20	2.01
44	002044	美年健康	12,744,710.65	2.01
45	000651	格力电器	12,726,109.00	2.00

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300021	大禹节水	44,756,154.61	7.05
2	000100	TCL 集团	42,704,963.51	6.72
3	000998	隆平高科	31,142,920.86	4.90
4	600000	浦发银行	30,860,253.50	4.86
5	600795	国电电力	29,031,324.75	4.57
6	002202	金风科技	28,879,362.36	4.55
7	603808	歌力思	27,814,835.49	4.38
8	300050	世纪鼎利	26,745,403.59	4.21
9	000669	金鸿能源	25,714,915.24	4.05
10	600737	中粮糖业	25,417,948.03	4.00
11	000651	格力电器	25,353,756.67	3.99
12	600027	华电国际	25,335,136.90	3.99
13	600584	长电科技	24,929,886.22	3.92
14	600688	上海石化	22,994,353.49	3.62
15	601336	新华保险	21,768,038.61	3.43

16	600011	华能国际	20,395,549.00	3.21
17	600900	长江电力	20,062,717.39	3.16
18	601928	凤凰传媒	19,720,505.76	3.10
19	600884	杉杉股份	18,979,599.50	2.99
20	600123	兰花科创	18,926,331.73	2.98
21	002640	跨境通	18,640,717.79	2.93
22	000959	首钢股份	18,525,102.78	2.92
23	000852	石化机械	18,370,050.24	2.89
24	300140	启源装备	18,308,510.49	2.88
25	600887	伊利股份	17,818,256.12	2.81
26	600886	国投电力	16,539,039.00	2.60
27	601333	广深铁路	16,202,771.52	2.55
28	600109	国金证券	15,843,673.99	2.49
29	600583	海油工程	14,984,592.10	2.36
30	603223	恒通股份	14,427,790.00	2.27
31	601222	林洋能源	14,023,680.90	2.21
32	300332	天壕环境	13,846,565.78	2.18
33	600297	广汇汽车	13,591,614.25	2.14
34	601166	兴业银行	13,501,835.00	2.13
35	601668	中国建筑	13,218,466.00	2.08
36	000725	京东方 A	13,174,870.62	2.07
37	600028	中国石化	12,874,890.00	2.03
38	300285	国瓷材料	12,855,617.27	2.02

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,593,635,643.47
卖出股票收入（成交）总额	1,354,024,665.42

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,145,055.33
2	应收证券清算款	95,095,441.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-21,070.16
5	应收申购款	1,322,456.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,541,883.12

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中未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**

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
10,675	49,494.17	10,132,294.91	1.92%	518,217,979.69	98.08%

### 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	5,307,207.09	1.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,550.05	1.89	10,000,550.05	1.89	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,550.05	1.89	10,000,550.05	1.89	3年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,000,550.05 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 550.05 份。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年12月12日）基金份额总额	496,272,148.83
本报告期期初基金份额总额	682,346,251.99
本报告期基金总申购份额	1,977,738.26
减：本报告期基金总赎回份额	155,973,715.65
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	528,350,274.60

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

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
安信证券股 份有限公司	4	41,734,345,899.07	58.89%	1,615,196.14	58.89%	-
光大证券股 份有限公司	2	797,484,701.73	27.08%	742,694.79	27.08%	-
国信证券股 份有限公司	2	334,431,094.86	11.36%	311,455.87	11.36%	-
中信证券股 份有限公司	4	78,662,934.44	2.67%	73,259.11	2.67%	-
中银国际证 券有限责任 公司	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。经公司批准与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
安信证券股 份有限公司	-	-	12,103,100,000.00	64.74%	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	3,158,300,000.00	16.89%	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	2,631,600,000.00	14.08%	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	801,000,000.00	4.28%	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易及权证交易。

## §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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日