

# 银华成长先锋混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	银华成长先锋混合型证券投资基金
基金简称	银华成长先锋混合
基金主代码	180020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 10 月 8 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	163,974,408.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点投资于成长型行业和公司及信用债券，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期增值。本基金的资产配置比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于成长型行业和公司股票的资产不低于股票资产的 80%；固定收益类资产占基金资产的比例为 15%-65%；权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%；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%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金属混合型基金，预期风险与预期收益水平高于债券基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010)58163000	(010)66105799
	电子邮箱	yhj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95588
传真		(010)58163027	(010)66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
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	-10,152,140.39
本期利润	-10,219,542.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0594
本期加权平均净值利润率	-5.46%
本期基金份额净值增长率	-5.37%
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	9,553,236.35
期末可供分配基金份额利润	0.0583
期末基金资产净值	173,527,644.50
期末基金份额净值	1.058
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	8.34%

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	5.80%	1.24%	3.41%	0.41%	2.39%	0.83%

过去三个月	-4.94%	1.10%	3.59%	0.39%	-8.53%	0.71%
过去六个月	-5.37%	0.89%	6.10%	0.35%	-11.47%	0.54%
过去一年	-12.27%	0.85%	9.29%	0.42%	-21.56%	0.43%
过去三年	12.08%	1.91%	48.61%	1.05%	-36.53%	0.86%
自基金合同生效起至今	8.34%	1.50%	31.12%	0.92%	-22.78%	0.58%

注：本基金业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%本金属于混合型基金，在分析本基金投资范围和资产配置比例的基础上，本基金选用市场代表性较好的沪深 300 指数收益率和中国债券总指数收益率加权作为业绩比较基准。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所联合编制、共同开发的中国 A 股市场指数，它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数，流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况。中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司，中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一，具有良好的市场代表性。

### 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第十一条：基金的投资（二）投资范围规定的各种比例，股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于成长型行业和公司股票的资产不低于股票资产的 80%；固定收益类资产占基金资产的比例为 15%-65%；权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出

资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。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		
王鑫钢先生	本基金的基金经理	2015 年 5 月 6 日	-	8 年	硕士学位。2008 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任行业研究员、行业研究组长及基金经理助理职务。自 2013 年 2 月 7 日起担任银华优势企业证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 1 日起兼任银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 14 日起兼任银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 17 日起兼任银华惠安定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 2 日起兼任银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 12 日起兼任银华惠丰定期开放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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。



## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华成长先锋混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

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

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

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,国内宏观经济整体运行平稳,一、二季度 GDP 同比增速都为 6.9%。基建投资增速仍维持高位,房地产行业经历了全国性的强力限购政策,但棚改发力三、四线城市去库存,一、

二线城市加大供地力度，使得房地产投资仍然维持较高增速，供给侧改革使得工业企业盈利能力大幅提升，其资产负债表进一步修复。全球发达国家的经济继续复苏，出口持续向好。海外方面，美联储于 3 月、6 月两次加息，特朗普受困于国内党派斗争而无法有效施政，欧洲大选有惊无险。

报告期内，国内金融去杠杆政策趋严，成为影响 A 股市场的核心因素。银行表外理财业务在 3 月底正式纳入 MPA 考核，二季度一行三会连续出台严厉的监管措施，超出市场预期，导致流动性收紧以及市场风险偏好降低。同时 IPO 发行常态化，壳资源价值降低。上半年 A 股市场的主基调就是风格极度分化，低估值的白马龙头股票震荡上涨，而高估值的中小市值股票震荡下跌。

本基金认为，短期国内经济保持平稳，金融监管趋严将持续，市场不具备产生趋势性行情的条件，区间震荡将是常态，估值合理的好公司将脱颖而出。若要取得较好收益，一方面要自下而上精选优质龙头公司，另一方面也需要根据流动性和市场风险偏好的变化波段操作。基于以上认识，本基金重点配置业绩确定、估值合理的优质成长型龙头公司，主要方向集中在消费电子、安防、智能控制、一带一路、影视游戏等领域，取得了一定相对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.058 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.37%，业绩比较基准收益率为 6.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，虽然中国经济短期存在诸多问题，但十三五期间是中国改革政策落地的密集期，国企改革、供给侧去产能、金融去杠杆等关键政策的执行落地将再次激活中国经济，改革红利将是中国经济结构成功转型的关键保障，我们对中国经济成功转型依然充满信心。中国的改革大潮不可阻挡，资本市场的制度建设也趋于完善，支撑资本市场走强的长期因素并未发生根本性逆转。

本基金认为，对于中国经济中长期不应该悲观，但短期也不能过于乐观。国内宏观经济短期运行平稳，但基建与房地产投资仍然是中国经济增长的核心动力，经济结构调整尚未完成，宏观经济中期仍处在稳步下滑寻底的换挡期，不应对短期宏观经济过于乐观。由信贷宽松驱动的投资对经济增长的贡献边际变弱，资产泡沫的负面效应却愈加显著。去年底的中央经济工作会议已定调稳健中性的货币政策，防风险和抑制资产泡沫是本阶段中国经济工作的最重点方向。对 A 股而言，下半年最核心的影响因素仍在于货币与金融监管政策，在防风险和抑制资产泡沫的大背景下，货币与金融监管政策在全年都易紧难松，A 股不具备趋势性的机会。在此背景下，下半年本基金将保持相对中性的仓位，继续通过自下而上的基本面研究优选适合中国经济未来发展方向、具有

优秀管理团队、业绩确定并且估值相对合理的成长龙头公司作为核心持仓，主要方向集中在 LED、消费电子、智能控制、新能源汽车、影视游戏、一带一路等领域。另外，本基金也会积极参与波段操作，根据市场风险偏好的变化做一些仓位的浮动与热点主题的轮动，以期取得较好的收益。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华成长先锋混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，银华成长先锋混合型证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华成长先锋混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华成长先锋混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华成长先锋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	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	12,235,181.85	39,635,912.75
结算备付金	545,511.70	1,432,971.55
存出保证金	158,605.13	163,408.21
交易性金融资产	167,271,539.26	167,622,507.93
其中：股票投资	137,355,539.26	127,806,507.93
基金投资	-	-
债券投资	29,916,000.00	39,816,000.00
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	87,724.47	-
应收利息	285,240.68	386,552.31
应收股利	-	-
应收申购款	1,318.07	13,859.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	180,585,121.16	209,255,212.69
<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	4,836,811.11	6,069,653.88
应付赎回款	78,157.83	104,667.09
应付管理人报酬	210,660.31	259,116.13
应付托管费	35,110.04	43,186.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	335,061.95	608,062.38
应交税费	1,268,720.54	1,268,720.54
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	292,954.88	219,290.13
负债合计	7,057,476.66	8,572,696.18
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	163,974,408.15	179,540,652.61
未分配利润	9,553,236.35	21,141,863.90
所有者权益合计	173,527,644.50	200,682,516.51
负债和所有者权益总计	180,585,121.16	209,255,212.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.058 元，基金份额总额为 163,974,408.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华成长先锋混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月
-----	------------------	------------------------------

	2017 年 6 月 30 日	30 日
<b>一、收入</b>	-7,069,037.02	-79,582,579.03
1.利息收入	543,520.36	981,047.50
其中：存款利息收入	74,645.51	93,332.08
债券利息收入	468,874.85	887,715.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-7,547,662.75	-50,060,117.52
其中：股票投资收益	-8,091,210.20	-50,008,358.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,881.92	-264,469.41
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	527,665.53	212,710.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-67,402.60	-30,516,564.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,507.97	13,055.48
<b>减：二、费用</b>	3,150,505.97	3,619,696.54
1. 管理人报酬	1,393,465.95	1,888,440.07
2. 托管费	232,244.27	314,740.07
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,330,185.60	1,221,421.42
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	194,610.15	195,094.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-10,219,542.99	-83,202,275.57
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-10,219,542.99	-83,202,275.57

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华成长先锋混合型证券投资基金

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)	179,540,652.61	21,141,863.90	200,682,516.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,219,542.99	-10,219,542.99
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)	-15,566,244.46	-1,369,084.56	-16,935,329.02
其中: 1.基金申购款	2,523,381.34	183,704.85	2,707,086.19
2.基金赎回款	-18,089,625.80	-1,552,789.41	-19,642,415.21
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)	163,974,408.15	9,553,236.35	173,527,644.50
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
一、期初所有者权益 (基金净值)	216,902,028.87	127,819,081.97	344,721,110.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-83,202,275.57	-83,202,275.57
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)	-14,025,631.11	-2,871,046.41	-16,896,677.52
其中: 1.基金申购款	8,115,793.03	1,743,474.55	9,859,267.58
2.基金赎回款	-22,141,424.14	-4,614,520.96	-26,755,945.10
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	202,876,397.76	41,745,759.99	244,622,157.75

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

#### 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》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。

#### (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。

### （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。

#### (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。

### 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它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
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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

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的管理费	1,393,465.95	1,888,440.07
其中：支付销售机构的客户维护费	567,227.16	721,128.23

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.5.1.2 基金托管费

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的托管费	232,244.27	314,740.07

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的债券（含回购）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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

**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：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。

**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
中国工商银行	12,235,181.85	66,765.57	16,403,382.10	85,510.68

**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 利润分配情况**

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

**6.4.7 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.7.1 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	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

			3 日							
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	-
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	-

#### 6.4.7.2 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
600146	商赢 环球	2017 年 1 月 5 日	重大 事项	32.37	-	-	123,400	4,442,400.00	3,994,458.00	-
300192	科斯 伍德	2017 年 3 月 6 日	重大 事项	14.02	-	-	193,600	2,948,956.06	2,714,272.00	-
300518	盛讯 达	2016 年 12 月 13 日	重大 事项	97.89	2017 年 7 月 10 日	101.97	22,400	3,169,087.88	2,192,736.00	-

#### 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.8 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金并无须说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	137,355,539.26	76.06
	其中：股票	137,355,539.26	76.06
2	固定收益投资	29,916,000.00	16.57
	其中：债券	29,916,000.00	16.57
	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	12,780,693.55	7.08
7	其他各项资产	532,888.35	0.30
8	合计	180,585,121.16	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,643,200.00	2.10
C	制造业	73,696,344.75	42.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,386,630.00	1.38
E	建筑业	6,691,692.00	3.86
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	37,201,129.43	21.44
J	金融业	6,901,638.00	3.98
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	6,834,905.08	3.94
S	综合	-	-
	合计	137,355,539.26	79.15

## 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投资股票。

## 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	002139	拓邦股份	749,050	8,067,268.50	4.65
2	000553	沙隆达 A	563,500	7,798,840.00	4.49
3	300083	劲胜智能	817,523	7,553,912.52	4.35
4	300628	亿联网络	23,100	7,021,476.00	4.05
5	300603	立昂技术	210,200	6,890,356.00	3.97
6	000065	北方国际	281,400	6,691,692.00	3.86
7	300310	宜通世纪	408,000	5,393,760.00	3.11
8	603040	新坐标	80,881	5,202,265.92	3.00
9	000997	新大陆	193,000	4,379,170.00	2.52
10	002624	完美世界	124,100	4,256,630.00	2.45

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	600063	皖维高新	11,107,642.08	5.53
2	300310	宜通世纪	10,402,262.33	5.18
3	603040	新坐标	10,086,104.00	5.03
4	300588	熙菱信息	9,725,425.12	4.85
5	000553	沙隆达 A	8,411,662.00	4.19
6	600764	中电广通	7,760,906.12	3.87
7	600873	梅花生物	7,644,303.98	3.81
8	000976	春晖股份	7,637,738.35	3.81

9	300603	立昂技术	7,435,960.52	3.71
10	600388	龙净环保	7,230,351.72	3.60
11	300628	亿联网络	7,227,766.70	3.60
12	300083	劲胜精密	7,138,941.05	3.56
13	002139	拓邦股份	6,946,212.25	3.46
14	603626	科森科技	6,941,423.90	3.46
15	000065	北方国际	6,862,583.60	3.42
16	600008	首创股份	5,862,486.00	2.92
17	002307	北新路桥	5,832,680.54	2.91
18	300444	双杰电气	5,593,215.60	2.79
19	600691	阳煤化工	5,351,613.55	2.67
20	002425	凯撒文化	4,698,134.10	2.34
21	002624	完美世界	4,305,565.00	2.15
22	300110	华仁药业	4,210,091.00	2.10
23	002443	金洲管道	4,048,594.00	2.02
24	300177	中海达	4,036,780.00	2.01
25	000997	新大陆	4,033,819.00	2.01

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	300310	宜通世纪	10,600,730.91	5.28
2	600063	皖维高新	10,176,094.12	5.07
3	600691	阳煤化工	9,786,702.00	4.88
4	000976	春晖股份	7,530,757.06	3.75
5	600764	中电广通	7,382,553.32	3.68
6	600388	龙净环保	7,165,432.55	3.57
7	002307	北新路桥	7,001,588.60	3.49
8	600583	海油工程	6,738,259.30	3.36
9	300110	华仁药业	6,596,994.01	3.29
10	000930	中粮生化	6,128,551.12	3.05
11	300588	熙菱信息	6,049,336.63	3.01
12	600873	梅花生物	6,012,647.35	3.00
13	600008	首创股份	5,734,950.00	2.86



14	603609	禾丰牧业	5,726,628.90	2.85
15	300444	双杰电气	5,371,955.73	2.68
16	600576	万家文化	5,194,509.37	2.59
17	000878	云南铜业	4,844,746.45	2.41
18	000998	隆平高科	4,737,360.44	2.36
19	603626	科森科技	4,662,943.00	2.32
20	300210	森远股份	4,430,238.37	2.21
21	002458	益生股份	4,356,683.67	2.17
22	002436	兴森科技	4,331,557.93	2.16
23	600115	东方航空	4,313,533.49	2.15
24	600961	株冶集团	4,302,444.00	2.14
25	000049	德赛电池	4,215,043.00	2.10
26	000018	神州长城	4,167,312.50	2.08
27	601800	中国交建	4,126,910.54	2.06
28	603040	新坐标	4,090,633.70	2.04
29	000889	茂业通信	4,055,274.49	2.02
30	601229	上海银行	4,050,599.00	2.02
31	601611	中国核电	4,032,603.66	2.01
32	600569	安阳钢铁	4,029,008.00	2.01

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	458,236,194.90
卖出股票收入（成交）总额	440,504,652.69

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	19,923,000.00	11.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,993,000.00	5.76
	其中：政策性金融债	9,993,000.00	5.76
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,916,000.00	17.24

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160419	16 农发 19	100,000	9,993,000.00	5.76
2	170009	17 付息国债 09	100,000	9,990,000.00	5.76
3	150012	15 付息国债 12	100,000	9,933,000.00	5.72

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

## 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：本基金本报告期末为投资国债期货。

## 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	158,605.13
2	应收证券清算款	87,724.47
3	应收股利	-
4	应收利息	285,240.68
5	应收申购款	1,318.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	532,888.35

### 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

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
5,070	32,342.09	2,994,134.63	1.83%	160,980,273.52	98.17%

**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	12,594.45	0.01%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2010年10月8日）基金份额总额	3,140,264,020.70
本报告期期初基金份额总额	179,540,652.61
本报告期基金总申购份额	2,523,381.34
减：本报告期基金总赎回份额	18,089,625.80
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	163,974,408.15

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

**§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

本报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券股份有限公司	3	223,499,284.26	24.88%	208,143.88	25.71%	-
西部证券股份有限公司	2	211,185,117.47	23.51%	196,676.79	24.29%	-
兴业证券股份有限公司	1	176,249,584.28	19.62%	164,140.84	20.27%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	60,016,564.11	6.68%	55,893.59	6.90%	-
招商证券股份有限公司	1	53,084,988.30	5.91%	49,437.47	6.11%	-
东吴证券股份有限公司	2	50,818,585.70	5.66%	37,163.75	4.59%	-

长江证券股份 有限公司	2	43,175,601.28	4.81%	31,574.06	3.90%	新增两个 交易席位
安信证券股 份有限公司	2	34,791,652.29	3.87%	25,443.13	3.14%	-
爱建证券有 限责任公司	1	22,315,957.07	2.48%	20,782.66	2.57%	-
中信证券股 份有限公司	1	12,706,670.95	1.41%	11,833.60	1.46%	-
浙商证券股 份有限公司	2	5,728,243.70	0.64%	4,188.87	0.52%	-
国信证券股 份有限公司	1	2,763,488.72	0.31%	2,573.54	0.32%	-
方正证券股 份有限公司	2	1,925,139.00	0.21%	1,792.98	0.22%	-
华泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	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。

### 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

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## §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