

# 银华永祥保本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	银华永祥保本混合型证券投资基金
基金简称	银华永祥保本混合
基金主代码	180028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 28 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	74,472,329.62 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用投资组合保险技术,在确保保本期到期时本金安全的基础上,通过保本资产和收益资产的动态平衡配置管理,实现组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和基于期权的组合保险策略。其中主要通过 CPPI 策略动态调整保本资产与收益资产的投资比例,以确保在保本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。 本基金在保本期内投资保本资产占基金资产的比例不低于 60%,其中持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%;投资收益资产占基金资产的比例不高于 40%,其中基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。
业绩比较基准	每个保本期起始日的 3 年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。

### 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		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住所

### §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	308,741.91
本期利润	347,040.38
加权平均基金份额本期利润	0.0043
本期加权平均净值利润率	0.30%
本期基金份额净值增长率	0.28%
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	42,048,739.45
期末可供分配基金份额利润	0.5646
期末基金资产净值	106,601,847.51
期末基金份额净值	1.431
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	65.09%

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

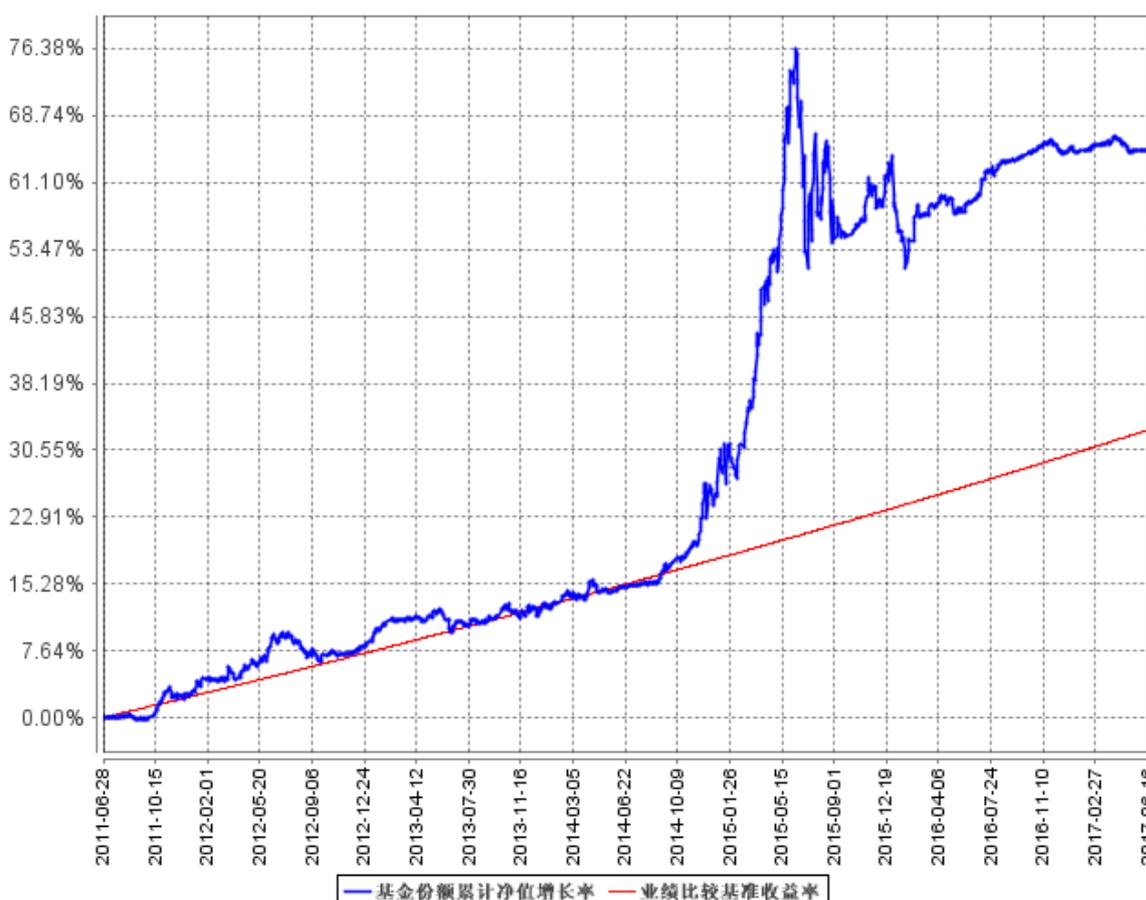
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.02%	0.39%	0.01%	-0.18%	0.01%
过去三个月	-0.28%	0.08%	1.19%	0.01%	-1.47%	0.07%
过去六个月	0.28%	0.08%	2.38%	0.01%	-2.10%	0.07%
过去一年	3.32%	0.11%	4.86%	0.01%	-1.54%	0.10%
过去三年	43.43%	0.61%	15.33%	0.01%	28.10%	0.60%
自基金合同生效起至今	65.09%	0.45%	33.06%	0.01%	32.03%	0.44%

注：本基金业绩比较基准为每个保本期起始日的 3 年期银行定期存款税后收益率。

本基金为保本混合型基金，保本期为三年，保本但不保证收益。在目前国内金融市场环境下，银行定期存款类似于保本定息产品，因此，本基金以 3 年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，可以合理的衡量本基金保本的有效性，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征。

### 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：本基金在保本期内投资保本资产占基金资产的比例不低于 60%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%；投资收益资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。

## §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		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2014 年 8 月 27 日	2017 年 8 月 7 日	8 年	硕士学位，2008 年 3 月至 2011 年 3 月期间任职于银华基金管理有限公司，担任行业研究员职务；2011 年 4 月至 2012 年 3 月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012 年 4 月至 2014 年 6 月期间任职于建信基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014 年 6 月起任职于银华基金管理有限公司，自

					<p>2014 年 8 月 27 日至 2016 年 12 月 22 日担任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2014 年 9 月 12 日起兼任银华保本增值证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 31 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥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。</p>
孙慧女士	本基金的基金经理	2016 年 2 月 6 日	2017 年 8 月 7 日	6.5 年	<p>硕士学位。2010 年 6 月至 2012 年 6 月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012 年 7 月至 2015 年 2 月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理；2015 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2016 年 2 月 6 日起兼任银华保本增值证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 17 日起兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金和银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华远</p>

					景债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥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。
冯帆女士	本基金的基金经理助理	2016 年 12 月 13 日	2017 年 8 月 7 日	3 年	理学硕士，曾就职于华夏未来资本管理有限公司，2015 年 8 月加入银华基金，历任投资管理三部宏观利率研究员，现任投资管理三部基金经理助理。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、《银华永祥保本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

2017 年上半年，权益市场的表现可谓一波三折。一季度，供给侧改革及需求侧补库造成周期板块躁动，而二季度则可概括为消费抱团及风格切换博弈。债券市场总体先抑后扬，年初在经济平稳、金融监管强化、流动性紧缩的共振下，呈现出剧烈调整之势，后随经济预期走弱、金融监管进入协调阶段、季末流动性平稳充裕而有所回暖。目前，债券各品种的长短端期限利差仍处于历史较低水平，同时信用风险继续呈现点状暴露之态。

2017 年上半年，本基金继续坚持稳健的投资策略，在控制信用风险的前提下保证基金组合的流动性，以实现组合资产的平稳增长。

#### 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 1.431 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.28%，业绩比较基准收益率为 2.38%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，经济环境总体稳中趋弱，货币政策在呵护实体经济以及协调金融监管的双重目的下，偏紧态度有望边际缓和，流动性大幅波动的现象预计难以再现。权益市场大概率延续结构分化和区间震荡特征。债券市场在经历了前期大幅调整后，配置价值有所显现，但在全球央行陆续进入紧缩周期、国内货币政策也尚无明显转向之际，趋势性行情仍需耐心等待。

2017 年下半年，本基金将做好转型准备，转型后仍以稳健为核心，积极参与股票和债券投

资，在控制信用风险的前提下保证基金组合的流动性，以实现组合资产的平稳增长。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华永祥保本混合型证券投资基金（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华永祥保本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	887,141.34	31,189,057.92
结算备付金	4,939,272.15	505,884.87
存出保证金	20,330.52	36,636.33
交易性金融资产	8,085,793.50	91,140,408.65
其中：股票投资	-	11,129,437.86
基金投资	-	-
债券投资	6,198,793.50	66,789,970.79
资产支持证券投资	1,887,000.00	13,221,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	93,600,349.10	-
应收证券清算款	18,313.15	214,927.88
应收利息	51,540.90	1,957,308.63
应收股利	-	-
应收申购款	626.30	148,462.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	107,603,366.96	125,192,686.53
<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	-	-
应付赎回款	123,830.13	66,788.42
应付管理人报酬	106,813.91	126,579.26
应付托管费	17,802.32	21,096.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	55,446.60	84,752.30

应交税费	418,546.00	418,546.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	279,080.49	191,094.42
负债合计	1,001,519.45	908,856.94
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	64,553,108.06	75,468,842.53
未分配利润	42,048,739.45	48,814,987.06
所有者权益合计	106,601,847.51	124,283,829.59
负债和所有者权益总计	107,603,366.96	125,192,686.53

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.431 元，基金份额总额为 74,472,329.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华永祥保本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	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>	1,585,293.39	-734,055.20
1.利息收入	1,929,849.92	3,161,786.14
其中：存款利息收入	462,930.37	62,583.74
债券利息收入	777,493.74	3,031,693.32
资产支持证券利息收入	109,245.58	-
买入返售金融资产收入	580,180.23	67,509.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-433,859.43	-2,184,556.42
其中：股票投资收益	-178,119.12	-3,885,979.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-320,124.64	1,687,823.49
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	64,384.33	13,600.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	38,298.47	-1,763,365.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	51,004.43	52,080.66
<b>减：二、费用</b>	<b>1,238,253.01</b>	<b>2,090,709.73</b>
1. 管理人报酬	696,866.16	793,064.13
2. 托管费	116,144.34	132,177.30
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	210,303.65	767,911.35
5. 利息支出	956.18	180,301.82
其中：卖出回购金融资产支出	956.18	180,301.82
6. 其他费用	213,982.68	217,255.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>347,040.38</b>	<b>-2,824,764.93</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>347,040.38</b>	<b>-2,824,764.93</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华永祥保本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）	75,468,842.53	48,814,987.06	124,283,829.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	347,040.38	347,040.38
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）	-10,915,734.47	-7,113,287.99	-18,029,022.46
其中：1.基金申购款	2,493,345.83	1,620,920.06	4,114,265.89
2. 基金赎回款	-13,409,080.30	-8,734,208.05	-22,143,288.35
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	64,553,108.06	42,048,739.45	106,601,847.51

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)	82,619,813.35	52,161,881.18	134,781,694.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,824,764.93	-2,824,764.93
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)	-1,427,027.85	-783,225.61	-2,210,253.46
其中：1.基金申购款	10,636,949.60	6,188,640.70	16,825,590.30
2.基金赎回款	-12,063,977.45	-6,971,866.31	-19,035,843.76
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)	81,192,785.50	48,553,890.64	129,746,676.14

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

本基金本报告期不涉及会计估计变更。

#### 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

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》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[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》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；
- (2) 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、债券免征营业税和增值税；
- (3) 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，暂不缴纳企业所得税；
- (4) 对基金所持上市公司股票，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，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；
- (5) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税；
- (6) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

### 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
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
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西南证券	134,397,058.72	100.00%	98,490,867.51	19.55%

#### 6.4.5.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的比例
西南证券	30,942,259.32	75.51%	43,962,241.36	76.37%

#### 6.4.5.1.3 债券回购交易

金额单位：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

	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
西南证券	3,906,500,000.00	100.00%	538,400,000.00	25.58%

#### 6.4.5.1.4 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西南证券	125,160.66	100.00%	54,826.99	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西南证券	91,724.37	19.55%	81,668.15	57.12%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等）。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.5.2 关联方报酬

##### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	696,866.16
其中：支付销售机构的客户维护费	234,008.32	285,975.51

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.5.2.2 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	116,144.34	132,177.30

注：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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

##### 6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

#### 6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	887,141.34	10,105.50	1,268,088.11	21,232.68

#### **6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### **6.4.5.7 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未有其他关联交易事项。

#### **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**

注：本基金本期末未持有股票投资。

##### **6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本期末未持有股票投资。

##### **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**

本基金本期末未持有银行间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**

本基金本期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	8,085,793.50	7.51
	其中：债券	6,198,793.50	5.76
	资产支持证券	1,887,000.00	1.75
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	93,600,349.10	86.99
	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	5,826,413.49	5.41
7	其他各项资产	90,810.87	0.08
8	合计	107,603,366.96	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

注：本基金本期末未持有股票投资。

#### 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

注：本基金本期末未持有股票投资。

### 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	600138	中青旅	2,370,226.48	1.91
2	000661	长春高新	2,204,016.20	1.77
3	601166	兴业银行	1,795,110.00	1.44
4	000998	隆平高科	1,791,586.00	1.44
5	601186	中国铁建	1,752,180.00	1.41
6	603228	景旺电子	1,736,195.00	1.40
7	000651	格力电器	1,505,002.00	1.21
8	600118	中国卫星	1,241,267.00	1.00
9	000800	一汽轿车	1,216,515.00	0.98
10	603979	金诚信	1,215,645.60	0.98
11	600030	中信证券	1,201,053.00	0.97
12	300444	双杰电气	1,195,527.62	0.96
13	600079	人福医药	1,190,610.56	0.96
14	601336	新华保险	1,177,380.00	0.95
15	600887	伊利股份	1,171,499.00	0.94
16	000687	华讯方舟	1,170,355.01	0.94
17	600418	江淮汽车	1,163,406.00	0.94
18	600583	海油工程	1,162,314.00	0.94
19	600998	九州通	1,159,922.05	0.93
20	601989	中国重工	1,155,526.00	0.93

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	600138	中青旅	2,884,132.83	2.32
2	000661	长春高新	2,799,716.00	2.25
3	000998	隆平高科	2,546,789.71	2.05
4	600079	人福医药	1,788,006.00	1.44
5	603228	景旺电子	1,766,863.09	1.42
6	601166	兴业银行	1,759,994.00	1.42
7	601186	中国铁建	1,678,643.00	1.35
8	000651	格力电器	1,635,020.00	1.32
9	600297	广汇汽车	1,366,650.00	1.10
10	600887	伊利股份	1,294,676.00	1.04

11	600118	中国卫星	1,249,934.00	1.01
12	300444	双杰电气	1,236,742.26	1.00
13	603979	金诚信	1,234,897.44	0.99
14	600030	中信证券	1,196,673.00	0.96
15	600011	华能国际	1,194,179.64	0.96
16	600329	中新药业	1,186,790.90	0.95
17	000800	一汽轿车	1,163,946.00	0.94
18	601989	中国重工	1,163,346.00	0.94
19	000687	华讯方舟	1,157,997.81	0.93
20	601336	新华保险	1,147,568.00	0.92

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	61,897,706.18
卖出股票收入（成交）总额	72,527,436.26

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	5,904,090.00	5.54
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）	294,703.50	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,198,793.50	5.81

**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	019563	17 国债 09	59,100	5,904,090.00	5.54
2	127004	模塑转债	2,550	294,703.50	0.28

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

**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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689206	16 永生 2A1	100,000	1,887,000.00	1.77

注：本基金本报告期末仅持有 1 只资产支持证券。

**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	20,330.52
2	应收证券清算款	18,313.15
3	应收股利	-
4	应收利息	51,540.90
5	应收申购款	626.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,810.87

### 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：本基金本期末未持有股票投资。

### 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
2,105	35,378.78	0.00	0.00%	74,472,329.62	100.00%

### 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	403,549.42	0.54%

### 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	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月28日）基金份额总额	1,429,131,529.53
本报告期期初基金份额总额	87,065,279.83
本报告期基金总申购份额	2,876,322.74
减：本报告期基金总赎回份额	15,469,272.95
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	74,472,329.62

注：总申购份额含转入份额，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
西南证券股 份有限公司	2	134,397,058.72	100.00%	125,160.66	100.00%	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限	2	-	-	-	-	-

公司						
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增一个 交易单元
中天证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

川财证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

### 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
西南证券股 份有限公司	30,942,259.32	75.51%	3,906,500,000.00	100.00%	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 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	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	10,037,517.81	24.49%	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
中信建投证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-

## §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

本基金的第二个保本期于 2017 年 7 月 31 日到期，鉴于本基金第二个保本期到期后将不再符合保本基金存续条件，因此本基金将按照《银华永祥保本混合型证券投资基金基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金，即“银华永祥灵活配置混合型证券投资基金”。

自 2017 年 8 月 8 日起，修订后的《银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《银华永祥保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日