

# 银华优势企业证券投资基金 2017 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华优势企业证券投资基金
基金简称	银华优势企业混合
基金主代码	180001
前端交易代码	180001
后端交易代码	180011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 13 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	804,401,830.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金，主要通过投资于中国加入 WTO 后具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	坚持平衡原则：平衡收益与风险；平衡长期收益与短期收益；平衡股票与债券的投资；平衡成长型与价值型股票的投资。 本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。 基于大盘走势关系基金投资全局，本基金充分重视对各市场趋势尤其是对股市大盘趋势的研判，并因此将控制基金仓位放在资产配置和投资组合中的优先位置。本基金资产配置采取自上而下的操作流程，而股票选择采取自下而上的操作流程。
业绩比较基准	标普中国 A 股 300 指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%。
风险收益特征	注重收益与风险的平衡，通过控制股票、债券的投资比重来获取中低风险下的中等收益。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896

	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场东方经贸城 C2 办公楼 15 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1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-37,793,525.45
本期利润	-52,461,700.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0638
本期加权平均净值利润率	-4.90%
本期基金份额净值增长率	-4.92%
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	205,131,868.29
期末可供分配基金份额利润	0.2550
期末基金资产净值	1,009,533,699.09
期末基金份额净值	1.2550
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	436.87%

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

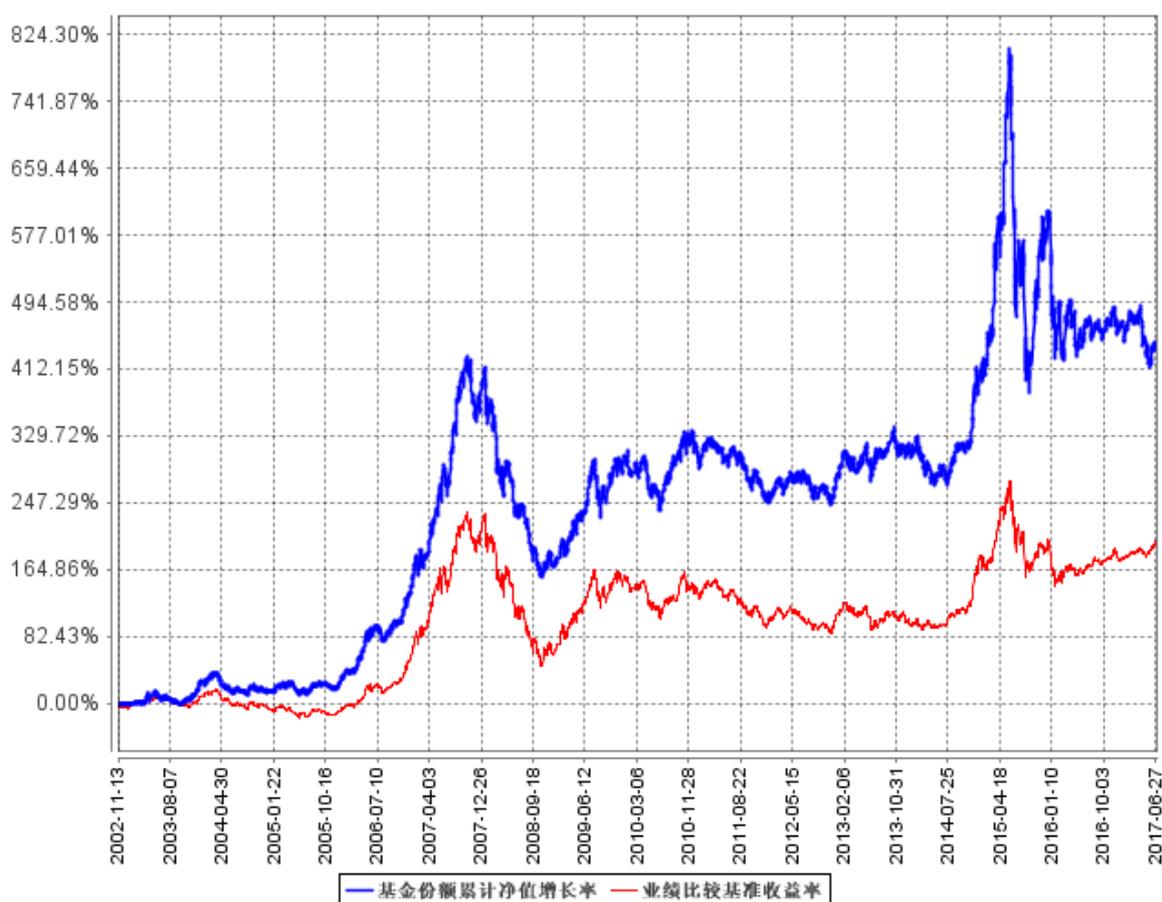
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.43%	0.86%	3.81%	0.48%	-1.38%	0.38%
过去三个月	-5.95%	0.97%	4.59%	0.45%	-10.54%	0.52%
过去六个月	-4.92%	0.83%	8.60%	0.40%	-13.52%	0.43%
过去一年	-5.10%	0.76%	13.48%	0.45%	-18.58%	0.31%
过去三年	36.31%	1.68%	52.46%	1.20%	-16.15%	0.48%
自基金合同生效起至今	436.87%	1.25%	200.40%	1.20%	236.47%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：标普中国 A 股 300 指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%。标普中国 A 股 300 指数包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大、最具流动性的 300 只股票并以流通股本加权的股票指数，是目前中国证券市场中与本基金股票投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数。

本基金的股票投资比例范围为：20-70%，所以本基金加入 20%的上证国债指数和 10%的同业活期存款利率一起构成本基金的业绩比较基准。

### 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内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十八条：基金的投资（二）投资对象及投资范围、（四）投资组合中规定的各项比例，本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

## §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	2013 年 2 月 7 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 2015 年 5 月 6 日起兼任银华成长先锋混合型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。
王利刚先生	本基金的基金经理助理	2016 年 2 月 1 日	-	4.5	工学硕士，2012 年 7 月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员，现任投资管理一部基金经理助理。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、《银华优势企业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 1.2550 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.92%，业绩比较基准收益率为 8.60%。

#### 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，主要方向集中在保险、一带一路、消费电子、智能控制、新能源汽车等领域。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”）在对银华优势企业证券投资基金（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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”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：银华优势企业证券投资基金

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	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	107,263,771.60	139,187,948.49
结算备付金		2,796,863.01	4,447,395.05
存出保证金		353,324.32	332,009.17
交易性金融资产	6.4.7.2	898,218,599.40	997,521,041.38
其中：股票投资		645,326,151.40	655,221,156.16
基金投资		-	-
债券投资		252,892,448.00	342,299,885.22
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	-	-
应收证券清算款		3,281,616.34	-
应收利息	6.4.7.5	3,705,501.13	5,253,048.46
应收股利		-	-
应收申购款		9,741.82	55,039.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,015,629,417.62	1,146,796,482.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,814,945.00	33,304,691.66
应付赎回款		730,720.99	1,197,773.78
应付管理人报酬		1,244,978.18	1,415,917.64
应付托管费		207,496.36	235,986.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,683,949.21	1,929,894.97

应交税费		60,187.20	60,187.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	353,441.59	260,206.35
负债合计		6,095,718.53	38,404,657.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	804,401,830.80	839,677,445.71
未分配利润	6.4.7.10	205,131,868.29	268,714,378.81
所有者权益合计		1,009,533,699.09	1,108,391,824.52
负债和所有者权益总计		1,015,629,417.62	1,146,796,482.39

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2550 元，基金份额总额 804,401,830.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华优势企业证券投资基金

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	附注号	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>		-38,053,044.84	-268,495,778.96
1.利息收入		4,204,987.11	4,710,924.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	277,977.07	486,079.96
债券利息收入		3,927,010.04	4,202,489.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	22,354.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,602,167.90	-37,145,013.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-28,240,651.90	-39,184,188.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,693,751.56	420,128.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	2,332,235.56	1,619,046.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,668,175.39	-236,080,575.35
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	12,311.34	18,885.23
<b>减：二、费用</b>		14,408,656.00	14,747,394.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,977,071.04	8,802,671.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,329,511.77	1,467,111.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,881,033.60	4,258,340.44
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	221,039.59	219,269.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-52,461,700.84	-283,243,173.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-52,461,700.84	-283,243,173.02

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华优势企业证券投资基金

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）	839,677,445.71	268,714,378.81	1,108,391,824.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,461,700.84	-52,461,700.84
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）	-35,275,614.91	-11,120,809.68	-46,396,424.59
其中：1.基金申购款	12,998,904.47	3,898,479.23	16,897,383.70
2.基金赎回款	-48,274,519.38	-15,019,288.91	-63,293,808.29
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	804,401,830.80	205,131,868.29	1,009,533,699.09



本基金投资的标的物为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资的重点是中国入世后以及在全球经济一体化过程中具有相对竞争优势即总成本领先优势和标新立异优势的上市公司所发行的股票，这部分投资的比例不低于本基金股票资产的 80%。本基金投资组合中股票投资比例浮动范围：20%-70%；债券投资比例浮动范围：20%-70%；现金留存比例浮动范围：5%-15%。投资证券的资产不低于基金总资产的 80%。投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金业绩比较基准：“标普中国 A 股 300 指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%”。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期财务报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

#### 6.4.7 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	107,263,771.60
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	107,263,771.60

##### 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	669,534,802.26	645,326,151.40	-24,208,650.86	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	45,628,728.83	43,926,448.00	-1,702,280.83
	银行间市场	209,702,830.00	208,966,000.00	-736,830.00
	合计	255,331,558.83	252,892,448.00	-2,439,110.83
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	924,866,361.09	898,218,599.40	-26,647,761.69	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**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**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**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	13,515.87
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	1,139.00
应收债券利息	3,690,654.05
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	49.11
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	143.10
合计	3,705,501.13

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**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	1,683,399.21
银行间市场应付交易费用	550.00
合计	1,683,949.21

**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	537.83
预提费用	283,396.69
其他	69,507.07
合计	353,441.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	839,677,445.71	839,677,445.71
本期申购	12,998,904.47	12,998,904.47
本期赎回(以“-”号填列)	-48,274,519.38	-48,274,519.38
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	804,401,830.80	804,401,830.80

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

#### 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
上年度末	692,478,269.54	-423,763,890.73	268,714,378.81
本期利润	-37,793,525.45	-14,668,175.39	-52,461,700.84
本期基金份额交易产生的变动数	-28,679,817.71	17,559,008.03	-11,120,809.68
其中：基金申购款	10,578,359.43	-6,679,880.20	3,898,479.23
基金赎回款	-39,258,177.14	24,238,888.23	-15,019,288.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	626,004,926.38	-420,873,058.09	205,131,868.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	252,153.75

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,383.95
其他	2,439.37
合计	277,977.07

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,631,435,993.20
减：卖出股票成本总额	1,659,676,645.10
买卖股票差价收入	-28,240,651.90

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,693,751.56
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,693,751.56

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	189,124,280.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	187,704,984.80
减：应收利息总额	3,113,047.69
买卖债券差价收入	-1,693,751.56

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,332,235.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,332,235.56

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-14,668,175.39
——股票投资	-13,941,522.97
——债券投资	-726,652.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-14,668,175.39

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	11,395.02
转换费收入	916.32
合计	12,311.34

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	4,880,483.60
银行间市场交易费用	550.00
合计	4,881,033.60

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
债券账户维护费	18,800.00
银行费用	8,842.90
合计	221,039.59

### 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

截至财务报表批准日，本基金无需做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
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
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。

**6.4.10 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****6.4.10.1.1 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
东北证券	201,098,416.93	6.10%	-	-
西南证券	1,033,854,356.76	31.38%	901,226,543.79	31.76%
第一创业	80,097,638.97	2.43%	-	-

**6.4.10.1.2 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	33,333,927.90	38.75%	-	-

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：本基金于本报告期及上年度可比会计期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 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
东北证券	187,283.28	6.33%	135,198.92	8.03%
西南证券	962,827.70	32.57%	564,213.39	33.52%
第一创业	74,594.74	2.52%	-	-
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	839,311.57	32.13%	474,985.80	47.29%

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。

**6.4.10.2 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	7,977,071.04	8,802,671.76
其中：支付销售机构的客户维护费	558,421.58	598,635.38

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

**6.4.10.2.2 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	1,329,511.77	1,467,111.96
----------------	--------------	--------------

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（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

注：本基金的基金管理人于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。

##### 6.4.10.4.2 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于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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
中国银行	107,263,771.60	252,153.75	65,045,002.97	457,965.56

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末进行利润分配。

## 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 (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	-
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	-
603617	君禾	2017 年	2017	新股流	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

	股份	6 月 23 日	年 7 月 3 日	通受限						
--	----	-------------	-----------------	-----	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 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
002175	东方网络	2017年3月9日	重大事项	14.25	2017年7月13日	14.74	842,780	14,007,045.59	12,009,615.00	-
002694	顾地科技	2017年5月25日	重大事项	21.81	-	-	1,600	33,272.71	34,896.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	1,000	3,395.91	3,600.00	-

#### 6.4.12.3 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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；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，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，另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。

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，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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

利率风险是指基金的财务状况和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、债券、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期	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

末 2017 年 6月 30 日							
资产							
银行存款	107,263,771.60	-	-	-	-	-	107,263,771.60
结算备付金	2,796,863.01	-	-	-	-	-	2,796,863.01
存出保证金	353,324.32	-	-	-	-	-	353,324.32
交易性金融资产		-69,930,000.00	139,036,000.00	43,926,448.00		-645,326,151.40	898,218,599.40
应收证券清算款		-	-	-	-	3,281,616.34	3,281,616.34
应收利息		-	-	-	-	3,705,501.13	3,705,501.13
应收申购款	100.00	-	-	-	-	9,641.82	9,741.82
资产总计	110,414,058.93	69,930,000.00	139,036,000.00	43,926,448.00		-652,322,910.69	1,015,629,417.62
负债							
应付证券清算款		-	-	-	-	1,814,945.00	1,814,945.00
应付赎回款		-	-	-	-	730,720.99	730,720.99
应付管理人报酬		-	-	-	-	1,244,978.18	1,244,978.18
应付托管		-	-	-	-	207,496.36	207,496.36

费							
应付交易费用						1,683,949.21	1,683,949.21
应交税费						60,187.20	60,187.20
其他负债						353,441.59	353,441.59
负债总计						6,095,718.53	6,095,718.53
利率敏感程度缺口	110,414,058.93	69,930,000.00	139,036,000.00	43,926,448.00		-646,227,192.16	1,009,533,699.09
上年度末 2016年 12月 31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	139,187,948.49						139,187,948.49
结算备付金	4,447,395.05						4,447,395.05
存出保证金	332,009.17						332,009.17
交易性金融资产			169,653,000.00	110,452,197.72	62,194,687.50	655,221,156.16	997,521,041.38
应收利息						5,253,048.46	5,253,048.46
应收申购款	100.00					54,939.84	55,039.84
其他资产							
资产总计	143,967,452.71		169,653,000.00	110,452,197.72	62,194,687.50	660,529,144.46	1,146,796,482.39

应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	33,304,691.66	33,304,691.66
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	1,197,773.78	1,197,773.78
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	1,415,917.64	1,415,917.64
应付 托管 费	-	-	-	-	-	235,986.27	235,986.27
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	1,929,894.97	1,929,894.97
应交 税费	-	-	-	-	-	60,187.20	60,187.20
其他 负债	-	-	-	-	-	260,206.35	260,206.35
负债 总计	-	-	-	-	-	38,404,657.87	38,404,657.87
利率 敏感 度缺 口	143,967,452.71	-169,653,000.00	110,452,197.72	62,194,687.50	622,124,486.59	1,108,391,824.52	

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-585,638.53	-1,840,376.32
-25 个基点	585,638.53	1,840,376.32	

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的 80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 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		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	645,326,151.40	63.92	655,221,156.16	59.11
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	252,892,448.00	25.05	342,299,885.22	30.88
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	898,218,599.40	88.97	997,521,041.38	90.00

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
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）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	55,422,421.28	74,343,527.01
	-5%	-55,422,421.28	-74,343,527.01

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 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	645,326,151.40	63.54
	其中：股票	645,326,151.40	63.54
2	固定收益投资	252,892,448.00	24.90
	其中：债券	252,892,448.00	24.90
	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	110,060,634.61	10.84
7	其他各项资产	7,350,183.61	0.72
8	合计	1,015,629,417.62	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	14,830,527.35	1.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	238,128,527.56	23.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,843,910.75	0.98
E	建筑业	169,091,696.56	16.75
F	批发和零售业	29,434,036.57	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	18,930.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,678,218.25	7.10
J	金融业	31,482,338.26	3.12
K	房地产业	21,734,682.80	2.15

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	35,107,907.70	3.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,975,375.60	2.37
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	645,326,151.40	63.92

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	占基金资产净值比例（%）
1	600068	葛洲坝	3,716,767	41,776,461.08	4.14
2	300210	森远股份	4,053,880	39,322,636.00	3.90
3	300422	博世科	2,179,457	35,089,257.70	3.48
4	600491	龙元建设	3,052,358	32,751,801.34	3.24
5	600388	龙净环保	1,698,362	26,375,561.86	2.61
6	002310	东方园林	1,577,419	26,374,445.68	2.61
7	300588	熙菱信息	744,097	25,887,134.63	2.56
8	000018	神州长城	3,289,300	24,900,001.00	2.47
9	300347	泰格医药	990,718	23,975,375.60	2.37
10	000065	北方国际	997,209	23,713,630.02	2.35
11	600266	北京城建	1,494,820	21,734,682.80	2.15
12	601169	北京银行	2,195,500	20,132,735.00	1.99
13	300457	赢合科技	291,630	19,947,492.00	1.98
14	300197	铁汉生态	1,474,048	19,575,357.44	1.94
15	600335	国机汽车	1,612,867	19,289,889.32	1.91
16	002439	启明星辰	1,009,900	18,784,140.00	1.86
17	000821	京山轻机	1,153,100	15,301,637.00	1.52
18	300031	宝通科技	815,100	14,989,689.00	1.48
19	002458	益生股份	717,119	14,808,507.35	1.47

20	603986	兆易创新	189,755	14,764,836.55	1.46
21	300115	长盈精密	432,944	12,633,305.92	1.25
22	002175	东方网络	842,780	12,009,615.00	1.19
23	600329	中新药业	588,360	10,655,199.60	1.06
24	300068	南都电源	628,990	10,592,191.60	1.05
25	600196	复星医药	340,600	10,555,194.00	1.05
26	600114	东睦股份	589,700	10,319,750.00	1.02
27	601336	新华保险	200,348	10,297,887.20	1.02
28	002074	国轩高科	323,900	10,219,045.00	1.01
29	002466	天齐锂业	186,845	10,155,025.75	1.01
30	002091	江苏国泰	1,061,295	10,135,367.25	1.00
31	002536	西泵股份	818,323	10,130,838.74	1.00
32	601689	拓普集团	301,300	10,090,537.00	1.00
33	600885	宏发股份	251,629	10,037,480.81	0.99
34	300335	迪森股份	512,975	9,833,730.75	0.97
35	000903	云内动力	1,165,207	5,301,691.85	0.53
36	002036	联创电子	303,600	5,009,400.00	0.50
37	000970	中科三环	338,700	5,005,986.00	0.50
38	601318	中国平安	20,446	1,014,326.06	0.10
39	603808	歌力思	33,750	996,300.00	0.10
40	000538	云南白药	1,000	93,850.00	0.01
41	000423	东阿阿胶	1,000	71,890.00	0.01
42	603040	新坐标	1,000	64,320.00	0.01
43	600436	片仔癀	1,000	61,040.00	0.01
44	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
45	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
46	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
47	002694	顾地科技	1,600	34,896.00	0.00
48	601601	中国太保	1,000	33,870.00	0.00
49	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
50	002236	大华股份	1,000	22,810.00	0.00
51	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
52	000998	隆平高科	1,000	22,020.00	0.00
53	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
54	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
55	600703	三安光电	1,000	19,700.00	0.00
56	600270	外运发展	1,000	18,930.00	0.00
57	300070	碧水源	1,000	18,650.00	0.00
58	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00

59	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
60	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
61	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
62	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
63	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
64	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
65	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
66	000759	中百集团	1,000	8,780.00	0.00
67	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
68	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
69	600008	首创股份	1,000	6,580.00	0.00
70	600795	国电电力	1,000	3,600.00	0.00
71	601288	农业银行	1,000	3,520.00	0.00

## 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	41,781,866.76	3.77
2	600863	内蒙华电	35,076,065.74	3.16
3	600491	龙元建设	34,972,991.59	3.16
4	600970	中材国际	34,239,470.27	3.09
5	000018	神州长城	33,150,535.86	2.99
6	600388	龙净环保	30,438,357.98	2.75
7	300422	博世科	30,338,085.96	2.74
8	601169	北京银行	30,007,838.04	2.71
9	600266	北京城建	28,540,192.20	2.57
10	002310	东方园林	28,150,936.06	2.54
11	300110	华仁药业	27,592,574.11	2.49
12	601991	大唐发电	27,459,765.78	2.48
13	300588	熙菱信息	27,017,441.69	2.44
14	300347	泰格医药	25,007,016.00	2.26
15	002430	杭氧股份	23,938,389.85	2.16
16	600068	葛洲坝	23,907,935.30	2.16
17	000553	沙隆达 A	23,253,163.55	2.10

18	600335	国机汽车	22,525,918.46	2.03
19	600048	保利地产	22,125,758.00	2.00
20	000998	隆平高科	21,714,275.99	1.96

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	600970	中材国际	48,393,300.37	4.37
2	000018	神州长城	43,659,722.01	3.94
3	600027	华电国际	41,662,713.93	3.76
4	002743	富煌钢构	38,260,300.87	3.45
5	300284	苏交科	31,430,712.46	2.84
6	300110	华仁药业	30,650,307.73	2.77
7	600863	内蒙华电	30,097,251.81	2.72
8	002116	中国海诚	29,977,220.02	2.70
9	601117	中国化学	29,885,239.99	2.70
10	601186	中国铁建	29,582,178.93	2.67
11	601991	大唐发电	29,467,314.20	2.66
12	000878	云南铜业	26,812,874.33	2.42
13	600362	江西铜业	25,126,838.81	2.27
14	002051	中工国际	24,682,343.39	2.23
15	002586	围海股份	24,317,210.01	2.19
16	601668	中国建筑	24,147,817.99	2.18
17	600008	首创股份	24,053,644.96	2.17
18	601601	中国太保	23,297,845.90	2.10
19	000998	隆平高科	23,212,613.05	2.09
20	601600	中国铝业	23,176,598.26	2.09
21	002447	壹桥股份	22,954,108.91	2.07
22	600048	保利地产	22,532,764.08	2.03

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	1,663,723,163.31
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,631,435,993.20
--------------	------------------

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	212,896,448.00	21.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,996,000.00	3.96
	其中：政策性金融债	39,996,000.00	3.96
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	252,892,448.00	25.05

## 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	160018	16 附息国债 18	700,000	69,930,000.00	6.93
2	170003	17 附息国债 03	500,000	49,805,000.00	4.93
3	179918	17 贴现国债 18	500,000	49,235,000.00	4.88
4	010107	21 国债(7)	428,300	43,926,448.00	4.35
5	150201	15 国开 01	400,000	39,996,000.00	3.96

## 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	353,324.32
2	应收证券清算款	3,281,616.34
3	应收股利	-
4	应收利息	3,705,501.13
5	应收申购款	9,741.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,350,183.61

**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
48,123	16,715.54	3,472,276.03	0.43%	800,929,554.77	99.57%

### 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	1,145.27	0.00%

### 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

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（2002年11月13日）基金份额总额	1,682,572,543.63
本报告期期初基金份额总额	839,677,445.71
本报告期基金总申购份额	12,998,904.47
减：本报告期基金总赎回份额	48,274,519.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	804,401,830.80

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

## §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

#### 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

本报告期内没有涉及本基金管理人、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

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

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，本基金管理人和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	21,033,854,356.76	31.38%	962,827.70	32.57%	—
国金证券股 份有限公司	1	508,049,306.79	15.42%	473,145.34	16.00%	—
华创证券有 限责任公司	2	316,325,105.62	9.60%	231,327.68	7.82%	—
东北证券股 份有限公司	2	201,098,416.93	6.10%	187,283.28	6.33%	—
中信建投证 券股份有限 公司	3	167,055,887.47	5.07%	155,578.81	5.26%	—
中信证券股 份有限公司	3	161,103,181.49	4.89%	150,035.00	5.07%	—
川财证券有 限责任公司	2	155,039,319.58	4.71%	113,379.73	3.83%	—
兴业证券股 份有限公司	1	86,509,744.31	2.63%	80,565.54	2.72%	—
财富证券股 份有限公司	1	85,788,183.30	2.60%	62,735.13	2.12%	新增 1 个 交易单元
国泰君安证 券股份有限 公司	2	81,443,931.01	2.47%	75,849.14	2.57%	—
第一创业证 券股份有限 公司	1	80,097,638.97	2.43%	74,594.74	2.52%	—
渤海证券股 份有限公司	3	60,762,877.96	1.84%	56,588.72	1.91%	—
中国银河证 券股份有限 公司	3	56,419,502.29	1.71%	52,543.36	1.78%	—
方正证券股 份有限公司	2	53,467,988.62	1.62%	49,794.60	1.68%	—
国信证券股 份有限公司	2	50,877,756.04	1.54%	47,382.16	1.60%	—
华泰证券股 份有限公司	1	50,793,391.80	1.54%	47,305.46	1.60%	—
中天证券有 限责任公司	1	43,199,263.04	1.31%	40,231.44	1.36%	—
申万宏源集 团股份有限 公司	2	35,331,753.65	1.07%	32,905.12	1.11%	—

平安证券有 限责任公司	1	30,991,441.62	0.94%	28,862.38	0.98%	-
招商证券股 份有限公司	2	28,283,363.98	0.86%	26,340.39	0.89%	-
华融证券股 份有限公司	2	7,855,407.93	0.24%	7,315.69	0.25%	-
首创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

华鑫证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股 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

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	33,333,927.90	38.75%	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2,960,434.78	3.44%	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	10,705,660.80	12.45%	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	11,043,708.80	12.84%	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证	-	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
渤海证券股 份有限公司	6,245,081.00	7.26%	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	21,728,195.60	25.26%	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	《银华基金管理股份有限公司2016年12月31日基金净值公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年1月3日
2	《银华优势企业证券投资基金2016年第4季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017年1月21日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月23日
4	《银华基金关于增加上海华信证券为旗下部分基金代销机构公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月24日
5	《关于旗下部分基金在首创证券开通定期定额投资及转换业务并参加首创证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月27日

6	《关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月28日
7	《关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年2月28日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月9日
9	《关于旗下部分基金参加上海华信证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月18日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年3月21日
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017年3月31日
12	《银华优势企业证券投资基金2016年年度报告》	本基金管理人网站	2017年3月31日
13	《银华优势企业证券投资基金2016年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2017年3月31日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的东方网络估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年4月20日
15	《银华优势企业证券投资基金2017年第1季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017年4月21日
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年4月22日
17	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的商赢环球、山东黄金估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017年4月26日
18	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017年6月1日
19	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海通华财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构	四大证券报及本基金管理人网站	2017年6月1日

	并参与其优惠费率活动的公告》		
20	《关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 22 日
21	《银华优势企业证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2017 年 6 月 27 日
22	《银华优势企业证券投资基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 27 日
23	《银华基金管理股份有限公司关于使用建设银行卡网上直销优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日

## §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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华优势企业证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华优势企业证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华优势企业证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华优势企业证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的住所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日