

# 银华优质增长混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：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.....	13
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.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</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.....	55

---

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华优质增长混合型证券投资基金
基金简称	银华优质增长混合
基金主代码	180010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 9 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	1,871,754,399.74 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于兼具优质增长性和估值吸引力的股票，在严格控制投资组合风险的前提下力求取得基金资产的长期快速增值。
投资策略	<p>本基金为混合型基金，在一般情况下，股票投资在基金资产中将保持相对较高的比例。在投资中，本基金首先选取质地良好、估值合理的公司，并从中精选具备优质增长特征或处于优质增长阶段的公司进行投资；在债券投资中，重点关注到期收益率、流动性较高以及价值被低估的债券。</p> <p>本基金的投资比例浮动范围：股票资产为 60%-95%；除股票资产以外的其他资产为 5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的非现金基金资产中，不低于 80% 的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

### 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	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	-3,019,768.10
本期利润	139,457,494.03
加权平均基金份额本期利润	0.0727
本期加权平均净值利润率	5.08%
本期基金份额净值增长率	5.21%
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	887,715,065.27
期末可供分配基金份额利润	0.4743
期末基金资产净值	2,759,469,465.01
期末基金份额净值	1.4743
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	378.46%

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	5.37%	0.72%	4.19%	0.54%	1.18%	0.18%
过去三个月	1.99%	0.64%	4.84%	0.50%	-2.85%	0.14%
过去六个月	5.21%	0.57%	8.42%	0.46%	-3.21%	0.11%
过去一年	8.60%	0.63%	12.75%	0.54%	-4.15%	0.09%
过去三年	50.89%	1.83%	59.38%	1.40%	-8.49%	0.43%
自基金合同	378.46%	1.63%	147.47%	1.47%	230.99%	0.16%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准选定为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。  
由于本基金属于混合型基金，一般情况下股票投资比例大约为 80%，本基金采用业界较为公认的、市场代表性较好的沪深 300 指数和中国债券总指数加权作为本基金的业绩评价基准。

### 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，截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条：基金的投资（二）投资范围规定的各种比例，本基金股票投资比例浮动范围：60%-95%；除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的非现金基金资产中，不低于 80%的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。

## §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		
王华先生	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资管理一部总监及 A 股基	2016 年 7 月 8 日	-	15 年	经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。曾在西南证券有限责任公司任职。2000 年 10 月加盟银华基金管理有限公司（筹），先后在研究策划部、基金经理部工作。曾于 2004 年 3 月 2 日至 2007 年 1 月 30 日任银华保本增值证券投资基金基金经理，于 2005 年 6 月 9 日至 2006 年 10 月 21 日期间任银华

	金投资 总监。				货币市场证券投资基金基金经理，自 2006 年 11 月 16 日至 2013 年 11 月 4 日期间任银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理，自 2013 年 8 月 6 日至 2016 年 7 月 8 日兼任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 12 日至 2016 年 12 月 22 日担任银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金，自 2015 年 11 月 16 日至 2017 年 6 月 8 日担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。
贲兴振 先生	本基金的 基金 经理	2016 年 11 月 2 日	-	9 年	硕士学位。历任北京城市系统工程研究中心研究员，新华基金管理股份有限公司行业分析师、策略师、基金经理、基金管理部副总监。2016 年 7 月加盟银华基金管理股份有限公司。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。

3、本基金管理人于 2017 年 8 月 5 日发布公告，王华先生自 2017 年 8 月 4 日起不再担任本基金基金经理。

#### 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、《银华优质增长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

本报告期内，市场结构性分化较大。利率阶段性上升、北上增量资金对市场估值体系的影响、A 股近几年对各行业龙头公司的估值折价等因素对高估值、小市值的绩差股都不利，该类股票出现了比较大幅度的调整，家电、白酒等业绩增长确定、股息率较高的标的，以及受益于供给侧改革和需求回暖的煤炭、钢铁等周期性行业，随着盈利水平的快速改善，股价都有较好的表现。

本基金配置方向重点在低估值领域，配置比较均衡，如银行、建筑建材、家电、汽车等行业，但对表现最好的家电、白酒、苹果产业链等行业超配比例不够。

#### 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 1.4743 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.21%，业

绩比较基准收益率为 8.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，7 月的政治局会议明确坚持以供给侧改革为主线，微观结构的分化仍将持续演绎，预计市场仍然是震荡市下的结构性机会。继续重点关注业绩增长和估值的匹配，坚持价值风格，重点看好金融、建筑央企、股价对供给收缩反应仍不充分的部分周期品以及趋势向好的新能源汽车产业链。

#### 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”）在对银华优质增长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：银华优质增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	204,674,340.29	184,338,154.61
结算备付金		43,200,788.82	10,066,029.69
存出保证金		696,609.71	736,748.14
交易性金融资产	6.4.7.2	2,250,794,208.64	1,999,381,152.54
其中：股票投资		2,250,794,208.64	1,999,381,152.54
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	546,100,405.00
应收证券清算款		285,997,763.57	9,132,942.34
应收利息	6.4.7.5	-21,375.74	205,887.01
应收股利		-	-
应收申购款		359,021.46	406,873.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,785,701,356.75	2,750,368,192.42
<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		13,481,858.56	-
应付赎回款		3,382,094.48	2,246,709.91
应付管理人报酬		3,318,875.04	3,540,507.53
应付托管费		553,145.83	590,084.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,753,640.19	2,932,482.63

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	742,277.64	641,675.43
负债合计		26,231,891.74	9,951,460.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,871,754,399.74	1,955,602,103.74
未分配利润	6.4.7.10	887,715,065.27	784,814,628.59
所有者权益合计		2,759,469,465.01	2,740,416,732.33
负债和所有者权益总计		2,785,701,356.75	2,750,368,192.42

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4743 元，基金份额总额

1,871,754,399.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华优质增长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	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>		178,396,013.44	-687,317,066.48
1.利息收入		6,543,339.29	2,267,896.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,364,768.62	2,267,896.06
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		5,178,570.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,292,251.72	-464,765,730.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,009,393.35	-479,538,293.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	14,282,858.37	14,772,563.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	142,477,262.13	-225,141,765.51
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	83,160.30	322,533.21
<b>减：二、费用</b>		38,938,519.41	60,891,896.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,394,479.27	29,809,863.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,399,079.90	4,968,310.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,911,785.45	25,891,845.06
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	233,174.79	221,876.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		139,457,494.03	-748,208,962.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		139,457,494.03	-748,208,962.51

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华优质增长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）	1,955,602,103.74	784,814,628.59	2,740,416,732.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,457,494.03	139,457,494.03
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）	-83,847,704.00	-36,557,057.35	-120,404,761.35
其中：1.基金申购款	36,855,442.40	15,944,365.50	52,799,807.90
2.基金赎回款	-120,703,146.40	-52,501,422.85	-173,204,569.25
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	1,871,754,399.74	887,715,065.27	2,759,469,465.01

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)	2,521,973,820.00	3,042,912,335.04	5,564,886,155.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-748,208,962.51	-748,208,962.51
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)	345,994,097.45	93,214,174.13	439,208,271.58
其中：1.基金申购款	721,275,634.93	257,038,027.32	978,313,662.25
2.基金赎回款	-375,281,537.48	-163,823,853.19	-539,105,390.67
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)	-	-1,362,198,754.66	-1,362,198,754.66
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,867,967,917.45	1,025,718,792.00	3,893,686,709.45

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 基金基本情况

银华优质增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]76号文《关于同意银华优质增长股票型证券投资基金募集申请的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于2006年4月29日至2006年6月7日向社会公开发行募集，基金合同于2006年6月9日正式生效，首次设立募集规模为9,834,925,970.23份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《公

开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，经协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，本基金名称由“银华优质增长股票型证券投资基金”更名为“银华优质增长混合型证券投资基金”。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具。在正常市场条件下，投资组合的范围：股票（A 股及监管机构授权投资的其他市场股票资产）、债券（国债、金融债、企业债、可转债等）、短期金融工具（含央行票据、债券回购等）以及现金资产；如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资比例浮动范围：股票资产为 60%-95%；除股票资产以外的其他资产为 5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的非现金基金资产中，不低于 80% 的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。本基金的业绩比较基准选定为：沪深 300 指数收益率×80%+ 中国债券总指数收益率×20%。

#### 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 年上半年度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	204,674,340.29
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	204,674,340.29

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,171,457,952.40	2,250,794,208.64	79,336,256.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,171,457,952.40	2,250,794,208.64	79,336,256.24

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**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	71,713.42
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	17,448.41
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-111,028.61
应收申购款利息	208.98
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	282.06
合计	-21,375.74

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,753,640.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,753,640.19

## 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	2,834.52
预提费用	305,833.98
其他	433,609.14
合计	742,277.64

## 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	1,955,602,103.74	1,955,602,103.74
本期申购	36,855,442.40	36,855,442.40
本期赎回(以“-”号填列)	-120,703,146.40	-120,703,146.40
- 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	1,871,754,399.74	1,871,754,399.74

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	1,000,949,898.22	-216,135,269.63	784,814,628.59
本期利润	-3,019,768.10	142,477,262.13	139,457,494.03
本期基金份额交易产生的变动数	-43,921,967.05	7,364,909.70	-36,557,057.35
其中：基金申购款	19,052,779.66	-3,108,414.16	15,944,365.50
基金赎回款	-62,974,746.71	10,473,323.86	-52,501,422.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	954,008,163.07	-66,293,097.80	887,715,065.27

**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	1,020,827.85
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	338,105.44
其他	5,835.33
合计	1,364,768.62

**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	4,900,691,435.82
减：卖出股票成本总额	4,885,682,042.47
买卖股票差价收入	15,009,393.35

**6.4.7.13 债券投资收益**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.1 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	14,282,858.37

基金投资产生的股利收益	-
合计	14,282,858.37

#### 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	142,477,262.13
——股票投资	142,477,262.13
——债券投资	-
——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	142,477,262.13

#### 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	70,555.91
转换费收入	12,604.39
合计	83,160.30

#### 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	14,911,785.45
银行间市场交易费用	-
合计	14,911,785.45

#### 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	52,068.27
信息披露费	148,765.71
债券账户维护费	17,200.00
银行费用	15,140.81
合计	233,174.79

#### 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		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	成交金额	占当期股票
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
东北证券	306,909,021.38	3.10%	-	-
西南证券	3,006,720,628.80	30.39%	3,577,727,829.22	21.48%
第一创业	1,057,006,255.22	10.68%	2,508,082,344.97	15.06%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 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
东北证券	325,000,000.00	0.85%	-	-
西南证券	15,575,100,000.00	40.53%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

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	285,824.67	3.13%	31,607.82	0.66%
西南证券	2,800,161.69	30.66%	1,518,911.51	31.95%
第一创业	984,387.21	10.78%	739,090.12	15.55%
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	3,331,933.55	21.64%	2,437,394.25	36.84%
第一创业	2,335,773.91	15.17%	-	-

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	20,394,479.27	29,809,863.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,897,070.28	1,962,659.91

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 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	3,399,079.90	4,968,310.60

注：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十个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 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与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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持有本基金份额。

**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	204,674,340.29	1,020,827.85	972,872,504.85	2,114,189.44

**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未进行利润分配。

**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**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**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
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	2,643,700	9,708,630.00	9,067,891.00	-

300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	重 大 事 项	37.28	-	-	183,759	6,869,951.61	6,850,535.52	-
--------	----------	--------------------------	------------------	-------	---	---	---------	--------------	--------------	---

### 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，其余均能及时变现。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、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	204,674,340.29	-	-	-	-	-	204,674,340.29
结算备付金	43,200,788.82	-	-	-	-	-	43,200,788.82
存出保证金	696,609.71	-	-	-	-	-	696,609.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,250,794,208.64	-2,250,794,208.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	285,997,763.57	285,997,763.57
应收利息	-	-	-	-	-	-21,375.74	-21,375.74
应收申购款	645.91	-	-	-	-	358,375.55	359,021.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	248,572,384.73	-	-	-	-	-2,537,128,972.02	2,785,701,356.75
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,481,858.56	13,481,858.56
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,382,094.48	3,382,094.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,318,875.04	3,318,875.04
应付托管费	-	-	-	-	-	553,145.83	553,145.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,753,640.19	4,753,640.19
其他负债	-	-	-	-	-	742,277.64	742,277.64

负债总计	-	-	-	-	-	26,231,891.74	26,231,891.74
利率敏感度缺口	248,572,384.73	-	-	-	-	-2,510,897,080.28	2,759,469,465.01
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	184,338,154.61	-	-	-	-	-	184,338,154.61
结算备付金	10,066,029.69	-	-	-	-	-	10,066,029.69
存出保证金	736,748.14	-	-	-	-	-	736,748.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,999,381,152.54	1,999,381,152.54
买入返售金融资产	546,100,405.00	-	-	-	-	-	546,100,405.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,132,942.34	9,132,942.34
应收利息	-	-	-	-	-	205,887.01	205,887.01
应收申购款	148.89	-	-	-	-	406,724.20	406,873.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	741,241,486.33	-	-	-	-	-2,009,126,706.09	2,750,368,192.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,246,709.91	2,246,709.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,540,507.53	3,540,507.53
应付托管费	-	-	-	-	-	590,084.59	590,084.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,932,482.63	2,932,482.63
其他负债	-	-	-	-	-	641,675.43	641,675.43
负债总计	-	-	-	-	-	9,951,460.09	9,951,460.09
利率敏感度缺口	741,241,486.33	-	-	-	-	-1,999,175,246.00	2,740,416,732.33

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

注：本基金于报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具。在正常市场条件下，投资组合的范围包括：股票

(A 股及监管机构授权投资的其他市场股票资产)、债券(国债、金融债、企业债、可转债等)、短期金融工具(含央行票据、债券回购等)以及现金资产;如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资比例浮动范围:本基金股票投资比例浮动范围:60%-95%;除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%-40%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的非现金基金资产中,不低于 80%的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。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	2,250,794,208.64	81.57	1,999,381,152.54	72.96
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	2,250,794,208.64	81.57	1,999,381,152.54	72.96

#### 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%	129,513,537.40	179,886,358.60
-5%	-129,513,537.40	-179,886,358.60	

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	2,250,794,208.64	80.80
	其中：股票	2,250,794,208.64	80.80
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	247,875,129.11	8.90
7	其他各项资产	287,032,019.00	10.30
8	合计	2,785,701,356.75	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	24,436,684.15	0.89
C	制造业	1,251,697,334.14	45.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,856,359.79	0.76
E	建筑业	82,414,462.52	2.99
F	批发和零售业	129,101,196.51	4.68
G	交通运输、仓储和邮政业	28,607,872.75	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,980,190.45	5.07
J	金融业	379,646,133.41	13.76
K	房地产业	37,540,869.96	1.36
L	租赁和商务服务业	19,271,953.28	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	64,062,719.80	2.32

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	73,178,431.88	2.65
S	综合	-	-
	合计	2,250,794,208.64	81.57

### 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	600030	中信证券	6,521,400	110,994,228.00	4.02
2	600176	中国巨石	7,319,717	80,370,492.66	2.91
3	600068	葛洲坝	6,301,573	70,829,680.52	2.57
4	002241	歌尔股份	3,394,849	65,452,688.72	2.37
5	601009	南京银行	5,516,330	61,838,059.30	2.24
6	601169	北京银行	6,530,964	59,888,939.88	2.17
7	000858	五粮液	1,045,570	58,196,426.20	2.11
8	002236	大华股份	2,437,979	55,610,300.99	2.02
9	600594	益佰制药	3,641,038	55,562,239.88	2.01
10	000001	平安银行	5,871,901	55,137,150.39	2.00
11	600887	伊利股份	2,120,766	45,787,337.94	1.66
12	000568	泸州老窖	852,262	43,107,411.96	1.56
13	000786	北新建材	2,677,448	42,410,776.32	1.54
14	002343	慈文传媒	975,110	36,917,664.60	1.34
15	000651	格力电器	887,565	36,541,051.05	1.32
16	000538	云南白药	376,554	35,339,592.90	1.28
17	600963	岳阳林纸	4,517,513	34,016,872.89	1.23
18	600703	三安光电	1,562,011	30,771,616.70	1.12
19	002055	得润电子	1,295,832	29,454,261.36	1.07
20	300426	唐德影视	1,243,036	29,410,231.76	1.07
21	600809	山西汾酒	821,292	28,490,619.48	1.03
22	000776	广发证券	1,626,157	28,051,208.25	1.02
23	002271	东方雨虹	747,989	27,750,391.90	1.01
24	002036	联创电子	1,669,760	27,551,040.00	1.00

25	000967	盈峰环境	2,477,624	26,857,444.16	0.97
26	000596	古井贡酒	522,981	26,645,881.95	0.97
27	300054	鼎龙股份	2,619,791	26,643,274.47	0.97
28	300170	汉得信息	2,575,757	26,556,054.67	0.96
29	603788	宁波高发	613,021	26,372,163.42	0.96
30	603686	龙马环卫	750,827	25,828,448.80	0.94
31	000028	国药一致	319,200	25,823,280.00	0.94
32	002668	奥马电器	1,305,300	25,714,410.00	0.93
33	300068	南都电源	1,460,878	24,601,185.52	0.89
34	600535	天士力	590,660	24,536,016.40	0.89
35	000983	西山煤电	2,786,395	24,436,684.15	0.89
36	300070	碧水源	1,292,836	24,111,391.40	0.87
37	603040	新坐标	372,400	23,952,768.00	0.87
38	000069	华侨城 A	2,331,500	23,454,890.00	0.85
39	001979	招商蛇口	1,089,968	23,281,716.48	0.84
40	002024	苏宁云商	2,018,817	22,711,691.25	0.82
41	600498	烽火通信	881,142	22,336,949.70	0.81
42	601607	上海医药	767,501	22,165,428.88	0.80
43	002368	太极股份	799,119	22,127,605.11	0.80
44	002250	联化科技	1,470,022	21,021,314.60	0.76
45	600461	洪城水业	2,892,699	20,856,359.79	0.76
46	002341	新纶科技	1,084,026	20,217,084.90	0.73
47	002027	分众传媒	1,400,578	19,271,953.28	0.70
48	601166	兴业银行	1,133,370	19,108,618.20	0.69
49	600858	银座股份	2,256,575	18,639,309.50	0.68
50	002304	洋河股份	213,796	18,559,630.76	0.67
51	300036	超图软件	1,132,848	18,522,064.80	0.67
52	300471	厚普股份	1,171,980	17,825,815.80	0.65
53	000910	大亚圣象	696,965	17,312,610.60	0.63
54	002462	嘉事堂	426,482	16,756,477.78	0.61
55	002217	合力泰	1,693,700	16,733,756.00	0.61
56	300033	同花顺	266,676	16,589,913.96	0.60
57	603588	高能环境	1,057,464	16,496,438.40	0.60
58	600702	沱牌舍得	610,876	16,255,410.36	0.59
59	601998	中信银行	2,577,571	16,212,921.59	0.59
60	600104	上汽集团	519,359	16,126,096.95	0.58
61	300232	洲明科技	999,430	15,990,880.00	0.58
62	600169	太原重工	4,103,700	15,840,282.00	0.57
63	600867	通化东宝	852,560	15,550,694.40	0.56

64	600079	人福医药	773,681	15,179,621.22	0.55
65	601688	华泰证券	823,832	14,746,592.80	0.53
66	600270	外运发展	778,479	14,736,607.47	0.53
67	600329	中新药业	809,951	14,668,212.61	0.53
68	300588	熙菱信息	413,890	14,399,233.10	0.52
69	600240	华业资本	1,573,858	14,259,153.48	0.52
70	601333	广深铁路	3,068,864	13,871,265.28	0.50
71	300339	润和软件	1,086,094	13,684,784.40	0.50
72	601788	光大证券	915,500	13,668,415.00	0.50
73	600335	国机汽车	1,105,960	13,227,281.60	0.48
74	300306	远方光电	756,607	13,111,999.31	0.48
75	601689	拓普集团	382,189	12,799,509.61	0.46
76	000895	双汇发展	505,409	12,003,463.75	0.43
77	300550	和仁科技	293,513	11,978,265.53	0.43
78	601668	中国建筑	1,196,775	11,584,782.00	0.42
79	603368	柳州医药	170,790	9,777,727.50	0.35
80	002215	诺普信	1,143,242	9,671,827.32	0.35
81	603239	浙江仙通	364,786	9,495,379.58	0.34
82	000100	TCL 集团	2,643,700	9,067,891.00	0.33
83	002465	海格通信	839,100	9,011,934.00	0.33
84	300231	银信科技	677,108	8,937,825.60	0.32
85	300369	绿盟科技	649,588	7,184,443.28	0.26
86	300364	中文在线	183,759	6,850,535.52	0.25
87	000799	酒鬼酒	291,200	5,352,256.00	0.19

## 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	601318	中国平安	107,414,827.31	3.92
2	600030	中信证券	106,779,697.50	3.90
3	601009	南京银行	99,932,907.27	3.65
4	600176	中国巨石	91,508,436.50	3.34
5	600585	海螺水泥	90,746,654.47	3.31
6	601169	北京银行	90,412,318.53	3.30
7	000651	格力电器	88,444,814.38	3.23

8	601998	中信银行	82,487,827.52	3.01
9	601166	兴业银行	76,265,522.00	2.78
10	600068	葛洲坝	74,444,189.05	2.72
11	000786	北新建材	73,248,929.89	2.67
12	002236	大华股份	71,803,594.62	2.62
13	600779	水井坊	70,259,965.19	2.56
14	600809	山西汾酒	68,382,271.20	2.50
15	002241	歌尔股份	65,555,465.83	2.39
16	000858	五粮液	61,575,814.12	2.25
17	601628	中国人寿	57,333,875.52	2.09
18	000001	平安银行	57,037,735.40	2.08
19	002036	联创电子	56,643,170.27	2.07
20	601186	中国铁建	56,023,876.43	2.04
21	601857	中国石油	55,971,839.52	2.04

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	601318	中国平安	126,457,620.03	4.61
2	600036	招商银行	122,296,899.84	4.46
3	601166	兴业银行	115,331,719.98	4.21
4	000651	格力电器	114,171,939.53	4.17
5	000786	北新建材	94,477,596.84	3.45
6	600585	海螺水泥	90,080,470.47	3.29
7	601009	南京银行	85,886,891.13	3.13
8	000333	美的集团	85,721,462.54	3.13
9	600104	上汽集团	83,808,710.22	3.06
10	600779	水井坊	81,965,214.30	2.99
11	002081	金螳螂	67,724,353.27	2.47
12	002250	联化科技	65,315,487.55	2.38
13	601998	中信银行	63,984,689.45	2.33
14	601628	中国人寿	58,793,268.88	2.15
15	600028	中国石化	57,452,019.55	2.10
16	600584	长电科技	56,246,247.53	2.05

17	601857	中国石油	55,995,850.79	2.04
18	600809	山西汾酒	55,308,289.26	2.02
19	600702	沱牌舍得	54,978,362.54	2.01
20	601186	中国铁建	53,701,623.72	1.96

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	4,994,617,836.44
卖出股票收入（成交）总额	4,900,691,435.82

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包括中信证券（证券代码：600030）。

根据中信证券股份有限公司于 2017 年 5 月 24 日发布的公告，该上市公司收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），中信证券在融资融券业务开展过程中，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31 号）第十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年……证券公司不得向其融资、融券”的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	696,609.71
2	应收证券清算款	285,997,763.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-21,375.74
5	应收申购款	359,021.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,032,019.00

### 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
54,154	34,563.55	30,154,936.60	1.61%	1,841,599,463.14	98.39%

### 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	159,007.48	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（2006年6月9日）基金份额总额	9,834,925,970.23
本报告期期初基金份额总额	1,955,602,103.74
本报告期基金总申购份额	36,855,442.40
减：本报告期基金总赎回份额	120,703,146.40
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	1,871,754,399.74

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基金托管人涉及托管业务的部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或者处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	23	23,006,720,628.80	30.39%	2,800,161.69	30.66%	—
国金证券股 份有限公司	11	11,260,080,575.75	12.73%	1,173,513.09	12.85%	—
第一创业证 券股份有限 公司	11	11,057,006,255.22	10.68%	984,387.21	10.78%	—
申万宏源集 团股份有限 公司	2	814,589,450.65	8.23%	758,623.55	8.31%	—
中信建投证 券股份有限 公司	3	528,270,574.95	5.34%	491,978.90	5.39%	—
方正证券股 份有限公司	2	514,967,203.93	5.20%	479,589.09	5.25%	—
中信证券股 份有限公司	3	484,465,697.20	4.90%	451,182.68	4.94%	—
东北证券股 份有限公司	2	306,909,021.38	3.10%	285,824.67	3.13%	—
渤海证券股 份有限公司	3	278,090,495.97	2.81%	258,987.26	2.84%	—
兴业证券股 份有限公司	1	196,267,199.69	1.98%	182,783.92	2.00%	—
财富证券股 份有限公司	1	190,150,241.32	1.92%	139,056.16	1.52%	新增 1 个 交易单元
华创证券有 限责任公司	2	166,306,804.16	1.68%	121,621.76	1.33%	—
华泰证券股 份有限公司	1	150,756,810.28	1.52%	140,400.67	1.54%	—
国泰君安证 券股份有限 公司	2	148,582,738.01	1.50%	138,375.41	1.52%	—
国信证券股 份有限公司	2	121,253,252.43	1.23%	112,924.04	1.24%	—
华西证券股 份有限公司	1	112,351,028.43	1.14%	104,633.22	1.15%	—
中银国际证 券有限责任 公司	1	104,603,700.53	1.06%	97,417.13	1.07%	—
国海证券股 份有限公司	1	102,148,770.30	1.03%	95,129.36	1.04%	—

招商证券股份有限公司	2	100,632,813.64	1.02%	93,719.76	1.03%	-
大同证券有限责任公司	1	94,685,607.55	0.96%	88,180.43	0.97%	-
中天证券有限责任公司	1	68,822,167.74	0.70%	64,094.04	0.70%	-
川财证券有限责任公司	2	54,444,202.98	0.55%	39,814.73	0.44%	-
中国银河证券股份有限公司	3	16,903,923.51	0.17%	15,742.04	0.17%	-
北京高华证券有限责任公司	1	16,300,107.84	0.16%	15,180.17	0.17%	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 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	-	-	15,575,100,000.00	40.53%	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	7,740,600,000.00	20.14%	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	3,222,700,000.00	8.39%	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	325,000,000.00	0.85%	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	625,100,000.00	1.63%	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	471,900,000.00	1.23%	-	-
财富证券股	-	-	3,037,800,000.00	7.90%	-	-

份有限公司						
华创证券有 限责任公司	-	-	888,700,000.00	2.31%	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	1,348,300,000.00	3.51%	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	1,219,200,000.00	3.17%	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	1,565,300,000.00	4.07%	-	-
华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	835,700,000.00	2.17%	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	418,000,000.00	1.09%	-	-
大同证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	1,155,700,000.00	3.01%	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

华鑫证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-

## 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	《银华优质增长混合型证券投资 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	《银华优质增长混合型证券投资 基金更新招募说明书（2017 年 第 1 号）》	本基金管理人网站	2017 年 1 月 23 日
4	《银华优质增长混合型证券投资 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 1 月 23 日
5	《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
6	《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
7	《关于旗下部分基金在首创证券	四大证券报及本基	2017 年 2 月 27 日

	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》	金管理人网站	
8	《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
9	《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
10	《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
11	《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
12	《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
13	《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
14	《银华优质增长混合型证券投资基金 2016 年年度报告》	本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
15	《银华优质增长混合型证券投资基金 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
16	《银华优质增长混合型证券投资基金 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
17	《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
18	《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
19	《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
20	《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》		
21	《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
22	《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质增长混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华优质增长混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华优质增长混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华优质增长混合型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