

银华保本增值证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 18 |
| 6.1 资产负债表..... | 18 |
| 6.2 利润表..... | 19 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 20 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 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 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 49 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 50 |
| 10.8 其他重大事件..... | 57 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| 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..... | 59 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| §12 备查文件目录..... | 60 |
| 12.1 备查文件目录..... | 60 |
| 12.2 存放地点..... | 60 |
| 12.3 查阅方式..... | 60 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 银华保本增值证券投资基金 |
| 基金简称 | 银华保本增值混合 |
| 基金主代码 | 180002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004 年 3 月 2 日 |
| 基金管理人 | 银华基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,480,158,916.29 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在确保保本周期到期时本金安全的基础上，谋求基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用“恒定比例投资组合保险策略”（CPPI），以实现基金的保本与增值。CPPI 主要是通过数量分析，根据市场的波动来调整、修正收益资产与保本资产在投资组合中的比重，以确保投资组合在保本周期结束时的保值增值。 |
| 业绩比较基准 | 以保本周期同期限的 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。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其风险收益配比关系为低风险、稳定收益。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨文辉 | 田青 |
| | 联系电话 | (010)58163000 | (010) 67595096 |
| | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006783333, (010)85186558 | (010) 67595096 |
| 传真 | | (010)58163027 | (010) 66275853 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心 |
| 邮政编码 | | 100738 | 100033 |

| | | |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 王珠林 | 王洪章 |
|-------|-----|-----|

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 | http://www.yhfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人办公地址 |

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 |
| 基金保证人 | 北京首创融资担保有限公司 | 北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心4号楼3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 | 18,182,196.53 |
| 本期利润 | 41,484,063.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0108 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.08% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.16% |
| 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 | 66,080,998.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0190 |
| 期末基金资产净值 | 3,517,466,920.74 |
| 期末基金份额净值 | 1.0107 |
| 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 | 128.71% |

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，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述本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

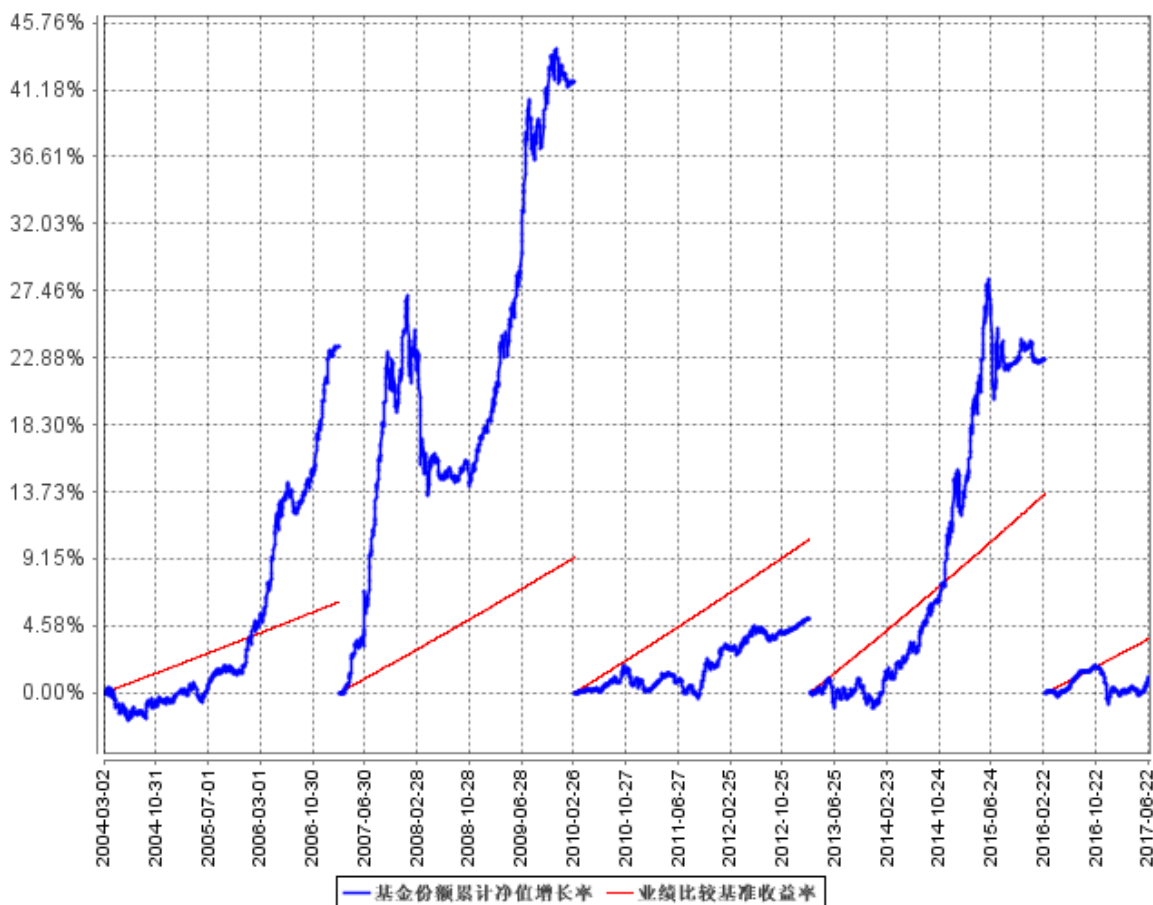
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 1.02% | 0.04% | 0.23% | 0.01% | 0.79% | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.91% | 0.05% | 0.69% | 0.01% | 0.22% | 0.04% |
| 过去六个月 | 1.16% | 0.05% | 1.37% | 0.01% | -0.21% | 0.04% |
| 过去一年 | 0.55% | 0.07% | 2.79% | 0.01% | -2.24% | 0.06% |
| 过去三年 | 20.05% | 0.25% | 11.36% | 0.01% | 8.69% | 0.24% |
| 第一个保本周期 (2004年 | 23.61% | 0.16% | 6.22% | 0.00% | 17.39% | 0.16% |

| | | | | | | |
|--|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 3月2日 (基金合同 生效日)至 2007年 3月1日) | | | | | | |
| 第二个保本 周期 (2007年 3月2日至 2010年 3月1日) | 41.80% | 0.35% | 9.24% | 0.00% | 32.56% | 0.35% |
| 第三个保本 周期 (2010年 3月2日至 2013年 3月1日) | 5.09% | 0.08% | 10.49% | 0.00% | -5.40% | 0.08% |
| 第四个保本 周期 (2013年 3月2日至 2016年 3月1日) | 18.02% | 0.30% | 13.60% | 0.01% | 4.42% | 0.29% |
| 第五个保本 周期 (2016年 3月2日) 至今 | 1.14% | 0.06% | 3.72% | 0.01% | -2.58% | 0.05% |
| 自基金合同 生效起至今 | 128.71% | 0.23% | 51.12% | 0.01% | 77.59% | 0.22% |

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，基金管理人自第五个保本周期开始之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：债券投资在资产配置中的比例不低于 60%，固定收益类金融产品和银行存款以外的资产在资产配置中的比例不高于 15%。

§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 9 月 12 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 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 8 月 7 日期间担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自 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 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，自 2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日担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。 |
| 孙慧女士 | 本基金的基金经理 | 2016 年 2 月 6 日 | - | 6.5 年 | 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，历任基金经理助理职务，自 2016 年 2 月 6 日起兼任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 2 月 6 日至 2017 年 8 月 7 日期间任银华永祥保本混合型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 日兼任银华远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 | 本基金的基金经理助理 | 2016 年 12 月 13 日 | - | 3 年 | 硕士学位；曾就职于华夏未来资本管理有限公司，2015 年 8 月加入银华基金管理有限公司，曾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职务。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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投

资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华保本增值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

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。权益方面，维持中性仓位水平，配置结构逐步从侧重周期到均衡配置，重点配置行业为消费、家电、电子、金融、建筑和汽车等。债券方面，总体以持有为主，同时结合市场环境变化择机进行了结构优化，并积极参与新股申购以增厚组合收益。

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 1.0107 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.16%，业绩比较基准收益率为 1.37%。

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，本基金将继续秉承 CPPI 策略，以稳健为核心，债券久期匹配下严格控制信用风险，权益资产波段操作，同时积极参与打新以增强收益。其中，权益投资优先考虑业绩的安全边际，以及行业的上升趋势是否能持续，关注金融、白酒、新能源汽车、电子、环保等行业。债券投资则将继续以持有为主，同时结合市场环境与流动性变化，继续优化组合结构。

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

本基金管理人本报告期内实施基金利润分配情况如下：

本基金于 2017 年 1 月 4 日发布分红公告，向于 2017 年 1 月 6 日在本基金注册登记机关登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.004 元，实际分配收益金额为人民币 1,644,542.36 元。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期实施利润分配的金额为 1,644,542.36 元。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：银华保本增值证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 738,857,003.16 | 544,130,920.67 |
| 结算备付金 | | 72,339,358.87 | 35,579,638.18 |
| 存出保证金 | | 95,153.94 | 149,015.29 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,262,294,634.06 | 4,142,209,336.19 |
| 其中：股票投资 | | 212,697,342.66 | 112,092,762.19 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,937,028,591.40 | 3,681,545,074.00 |
| 资产支持证券投资 | | 112,568,700.00 | 348,571,500.00 |
| 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 | 99,900,349.85 | 320,601,400.90 |
| 应收证券清算款 | | 13,710,317.41 | 2,806,077.28 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 53,531,629.47 | 69,594,929.30 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,374.97 | 514.79 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 5,240,729,821.73 | 5,115,071,832.60 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | 1,699,828,824.65 | 980,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 10,541,246.62 | - |
| 应付赎回款 | | 5,397,357.97 | 5,338,793.28 |
| 应付管理人报酬 | | 3,494,027.20 | 4,309,570.06 |
| 应付托管费 | | 582,337.88 | 718,261.68 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 176,324.52 | 311,197.74 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | 3,114,932.56 | 3,114,932.56 |
| 应付利息 | | -221,590.51 | 38,451.56 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 349,440.10 | 258,097.06 |
| 负债合计 | | 1,723,262,900.99 | 994,089,303.94 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 3,451,385,922.50 | 4,088,798,707.08 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 66,080,998.24 | 32,183,821.58 |
| 所有者权益合计 | | 3,517,466,920.74 | 4,120,982,528.66 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,240,729,821.73 | 5,115,071,832.60 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0107 元，基金份额总额 3,480,158,916.29 份。

6.2 利润表

会计主体：银华保本增值证券投资基金

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 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 84,028,398.50 | 41,678,918.72 |
| 1.利息收入 | | 95,170,587.89 | 54,975,217.75 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 19,841,630.12 | 4,551,996.99 |
| 债券利息收入 | | 70,761,580.77 | 39,954,715.02 |
| 资产支持证券利息收入 | | 3,141,418.38 | 3,576,414.54 |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,425,958.62 | 6,892,091.20 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -37,007,959.67 | -7,995,569.78 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 6,124,540.30 | -9,362,726.92 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -44,597,384.58 | 1,378,082.67 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | 75,509.46 | -10,925.53 |
| 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 | 1,389,375.15 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 23,301,866.87 | -5,938,175.66 |
| 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 | 2,563,903.41 | 637,446.41 |
| 减：二、费用 | | 42,544,335.10 | 24,389,531.45 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 22,924,932.42 | 20,142,214.13 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,820,822.07 | 3,357,035.67 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 231,578.54 | 182,414.78 |
| 5. 利息支出 | | 15,330,168.69 | 458,543.97 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 15,330,168.69 | 458,543.97 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 236,833.38 | 249,322.90 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 41,484,063.40 | 17,289,387.27 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 41,484,063.40 | 17,289,387.27 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华保本增值证券投资基金

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） | 4,088,798,707.08 | 32,183,821.58 | 4,120,982,528.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 41,484,063.40 | 41,484,063.40 |
| 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） | -637,412,784.58 | -5,942,344.38 | -643,355,128.96 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,375,897.46 | 22,821.83 | 2,398,719.29 |
| 2.基金赎回款 | -639,788,682.04 | -5,965,166.21 | -645,753,848.25 |
| 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） | - | -1,644,542.36 | -1,644,542.36 |
| 五、期末所有者权益 | 3,451,385,922.50 | 66,080,998.24 | 3,517,466,920.74 |

| 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) | 911,507,574.00 | 60,562,928.98 | 972,070,502.98 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 17,289,387.27 | 17,289,387.27 |
| 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) | 3,594,967,589.26 | -14,869,071.69 | 3,580,098,517.57 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,979,706,400.92 | 84,597.82 | 3,979,790,998.74 |
| 2.基金赎回款 | -384,738,811.66 | -14,953,669.51 | -399,692,481.17 |
| 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) | 4,506,475,163.26 | 62,983,244.56 | 4,569,458,407.82 |

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

银华保本增值证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银华保本增值证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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[2004]9号文批准公开发行。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为6,073,617,942.08份,经安永华明会计师事务所有限公司验证。《银华保本增值证券投资基金基金合同》于2004年3月2日正式生效并于2004年10月16日及2007年5月29日分

别修订。本基金因自 2007 年 7 月 1 日起执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”),于 2007 年 9 月 29 日公告了修改后的基金合同(以下简称“修改后的基金合同”)。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金的基金管理人于 2016 年 3 月 1 日对本基金进行基金份额拆分。根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为 1: 1.040540847(保留到小数点后 9 位),拆分后基金份额净值为人民币 1.0000 元。

根据《银华保本增值证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金自 2016 年 3 月 2 日起至三年后对应日(即 2019 年 3 月 1 日)止为本基金第五个保本周期,由北京首创融资担保有限公司(以下简称“北京首创”)担任担保人,北京首创为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证范围为:在本基金份额持有人持有到期的前提下,在保本周期到期日可赎回金额加上其在该保本周期内的累计分红金额,低于该基金份额持有人投资金额的差额部分;保证期限为基金保本周期到期日起六个月止。上文持有到期指基金持有人在保本周期内一直持有其所认购的基金份额的行为。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及最新公告的《银华保本增值证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在每一个保本周期内,资产类别的配置关系应为固定收益类金融产品和银行存款以外的资产在资产配置中的比例不高于 15%;债券投资在资产配置中的比例不低于 60%。本基金的业绩比较基准是与保本周期同期限的银行定期存款税后收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则以及 2014 年新颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金

净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更事项。

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事项说明。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正事项。

6.4.6 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[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》、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；

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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 | 8,857,003.16 |
| 定期存款 | 730,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 300,000,000.00 |
| 存款 3 个月-1 年 | 430,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 738,857,003.16 |

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 | 207,736,538.02 | 212,697,342.66 | 4,960,804.64 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,706,641,264.64 | 1,672,653,191.40 |
| | 银行间市场 | 2,275,278,942.16 | 2,264,375,400.00 |
| | 合计 | 3,981,920,206.80 | 3,937,028,591.40 |
| 资产支持证券 | 112,731,905.55 | 112,568,700.00 | -163,205.55 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 4,302,388,650.37 | 4,262,294,634.06 | -40,094,016.31 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | |
|------------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 99,900,349.85 | - |
| 合计 | 99,900,349.85 | - |

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。

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 | 9,824.47 |
| 应收定期存款利息 | 3,391,124.02 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 32,552.70 |
| 应收债券利息 | 49,629,021.71 |
| 应收买入返售证券利息 | 67,677.36 |
| 应收申购款利息 | 15.45 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 401,413.76 |
| 合计 | 53,531,629.47 |

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 | 142,589.90 |
| 银行间市场应付交易费用 | 33,734.62 |
| 合计 | 176,324.52 |

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 | 31,589.66 |
| 预提费用 | 298,354.28 |
| 应付其他 | 19,496.16 |
| 合计 | 349,440.10 |

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 | 4,122,892,328.06 | 4,088,798,707.08 |
| 本期申购 | 2,395,691.96 | 2,375,897.46 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -645,129,103.73 | -639,788,682.04 |
| - 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 | 3,480,158,916.29 | 3,451,385,922.50 |

注：本期申购含红利再投、转换入份额及金额，本期赎回含转换出份额及金额。

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 | 108,162,406.72 | -75,978,585.14 | 32,183,821.58 |
| 本期利润 | 18,182,196.53 | 23,301,866.87 | 41,484,063.40 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -17,806,050.66 | 11,863,706.28 | -5,942,344.38 |
| 其中：基金申购款 | 66,803.51 | -43,981.68 | 22,821.83 |
| 基金赎回款 | -17,872,854.17 | 11,907,687.96 | -5,965,166.21 |
| 本期已分配利润 | -1,644,542.36 | - | -1,644,542.36 |
| 本期末 | 106,894,010.23 | -40,813,011.99 | 66,080,998.24 |

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 | 202,886.22 |
| 定期存款利息收入 | 19,055,846.41 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 581,922.61 |
| 其他 | 974.88 |
| 合计 | 19,841,630.12 |

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 | 39,758,838.13 |
| 减：卖出股票成本总额 | 33,634,297.83 |
| 买卖股票差价收入 | 6,124,540.30 |

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 | -44,597,384.58 |
| 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 | -44,597,384.58 |

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 | 2,158,918,168.13 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,154,897,496.79 |
| 减：应收利息总额 | 48,618,055.92 |
| 买卖债券差价收入 | -44,597,384.58 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 239,929,436.08 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 236,952,118.58 |
| 减：应收利息总额 | 2,901,808.04 |
| 资产支持证券投资收益 | 75,509.46 |

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 | 1,389,375.15 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,389,375.15 |

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 | 23,301,866.87 |
| ——股票投资 | 699,991.76 |

| | |
|------------|---------------|
| ——债券投资 | 21,652,556.53 |
| ——资产支持证券投资 | 949,318.58 |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 23,301,866.87 |

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 | 2,545,706.24 |
| 转换费收入 | 18,197.17 |
| 合计 | 2,563,903.41 |

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 | 215,778.54 |
| 银行间市场交易费用 | 15,800.00 |
| 合计 | 231,578.54 |

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 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 债券账户维护费 | 18,600.00 |
| 银行费用 | 19,879.10 |
| 合计 | 236,833.38 |

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

本基金本报告期不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。

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 |
|------------------------|----------------|
| 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 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 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 | 102,449,807.56 | 59.69% | 12,454,402.27 | 12.70% |

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 |
|------|------------|------------------|--------------|------------------|
| 东北证券 | 811,616.38 | 0.09% | 1,130,647.05 | 0.15% |

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 | 273,900,000.00 | 0.33% | - | - |

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 | 95,411.06 | 59.69% | 85,374.85 | 59.87% |
| 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 |
| 东北证券 | 11,598.75 | 12.70% | 11,598.75 | 42.71% |

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 | 22,924,932.42 | 20,142,214.13 |

| | | |
|---------------------|--------------|--------------|
| 其中：支付销售机构的 客户维护费 | 5,468,695.31 | 5,429,047.23 |
|---------------------|--------------|--------------|

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 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 | 3,820,822.07 | 3,357,035.67 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | | | | | | |
|---------------------------------|--------|------|----------------|------------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 第一创业 | - | - | 489,967,000.00 | 291,295.45 | - | - |

注：本基金本报告期末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可比期间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 |
| 中国建设银行 | 8,857,003.16 | 202,886.22 | 11,751,457.74 | 530,292.55 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每10份 基金份额分 红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|---------------|-----|-----------------------|---------------------|--------------|---------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2017年 1月6日 | - | 2017 年 1月 6日 | 0.004 | 1,644,542.36 | - | -1,644,542.36 | |
| 合计 | - | - | | 0.004 | 1,644,542.36 | - | -1,644,542.36 | |

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: | 期末 成本总额 | 期末估值 总额 | 备注 |

| | | | | | | | 股) | | | |
|--------|------|--------------------|--------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 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 | 君禾股份 | 2017年 6月 23日 | 2017年 7月 3日 | 新股流 通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

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 | 复牌日期 | 复牌开盘单 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|-------|------|-------|-------|--------|--------|----|

| | | | | 价 | | 价 | | | | |
|--------|------|------------|------|-------|---|---|-------|-----------|-----------|---|
| 603238 | 诺邦股份 | 2017年5月15日 | 重大事项 | 29.38 | - | - | 1,750 | 23,292.50 | 51,415.00 | - |
| 300582 | 英飞特 | 2017年6月5日 | 重大事项 | 18.92 | - | - | 2,038 | 20,181.15 | 38,558.96 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 011751024 | 17 邮政 SCP001 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.25 | 2,000,000 | 200,500,000.00 |
| 011753017 | 17 中电投 SCP005 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.16 | 925,000 | 92,648,000.00 |
| 011753026 | 17 联通 SCP001 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.12 | 500,000 | 50,060,000.00 |
| 041654055 | 16 华能集 CP002 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.15 | 1,000,000 | 100,150,000.00 |
| 041764011 | 17 京能电力 CP001 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.21 | 210,000 | 21,044,100.00 |
| 041769004 | 17 国家核电 CP001 | 2017 年 7 月 4 日 | 100.12 | 2,000,000 | 200,240,000.00 |
| 合计 | | | | 6,635,000 | 664,642,100.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,049,600,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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，除在附注 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，并通过设定流动性比例要求，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。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金所持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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 | 8,857,003.16 | 630,000,000.00 | 100,000,000.00 | - | - | - | 738,857,003.16 |
| 结算备付金 | 72,339,358.87 | - | - | - | - | - | 72,339,358.87 |
| 存出保证金 | 95,153.94 | - | - | - | - | - | 95,153.94 |
| 交易性金融资产 | 250,680,000.00 | 634,571,868.30 | 1,286,878,719.60 | 1,694,021,300.00 | 70,876,703.50 | 325,266,042.66 | 4,262,294,634.06 |
| 买入返售金融资产 | 99,900,349.85 | - | - | - | - | - | 99,900,349.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 13,710,317.41 | 13,710,317.41 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 53,531,629.47 | 53,531,629.47 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,374.97 | 1,374.97 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 431,871,865.82 | 1,264,571,868.30 | 1,386,878,719.60 | 1,694,021,300.00 | 70,876,703.50 | 392,509,364.51 | 5,240,729,821.73 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回 | 1,699,828,824.65 | - | - | - | - | - | 1,699,828,824.65 |

| | | | | | | | |
|-------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 购金融资产款 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | | | | 10,541,246.62 | 10,541,246.62 |
| 应付赎回款 | | | | | | 5,397,357.97 | 5,397,357.97 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 3,494,027.20 | 3,494,027.20 |
| 应付托管费 | | | | | | 582,337.88 | 582,337.88 |
| 应付交易费用 | | | | | | 176,324.52 | 176,324.52 |
| 应付利息 | | | | | | -221,590.51 | -221,590.51 |
| 应交税费 | | | | | | 3,114,932.56 | 3,114,932.56 |
| 其他负债 | | | | | | 349,440.10 | 349,440.10 |
| 负债总计 | 1,699,828,824.65 | | | | | 23,434,076.34 | 1,723,262,900.99 |
| 利率敏感度缺口 | -1,267,956,958.83 | 1,264,571,868.30 | 1,386,878,719.60 | 1,694,021,300.00 | 70,876,703.50 | 369,075,288.17 | 3,517,466,920.74 |
| 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 | 4,130,920.67 | 140,000,000.00 | 400,000,000.00 | | | | 544,130,920.67 |
| 结算备付金 | 35,579,638.18 | | | | | | 35,579,638.18 |
| 存出保证金 | 149,015.29 | | | | | | 149,015.29 |
| 交易性金融资产 | 63,795,000.00 | | 1,054,887,374.00 | 2,797,562,200.00 | 113,872,000.00 | 112,092,762.19 | 4,142,209,336.19 |
| 买入返售金融资产 | 120,000,500.00 | 200,600,900.90 | | | | | 320,601,400.90 |
| 应收证 | | | | | | 2,806,077.28 | 2,806,077.28 |

| | | | | | | | |
|-----------|-----------------|----------------|------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 券清算款 | | | | | | | |
| 应收利息 | | | | | | 69,594,929.30 | 69,594,929.30 |
| 应收申购款 | | | | | | 514.79 | 514.79 |
| 资产总计 | 223,655,074.14 | 340,600,900.90 | 1,454,887,374.00 | 2,797,562,200.00 | 113,872,000.00 | 184,494,283.56 | 5,115,071,832.60 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 980,000,000.00 | | | | | | 980,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | | | | | | 5,338,793.28 | 5,338,793.28 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 4,309,570.06 | 4,309,570.06 |
| 应付托管费 | | | | | | 718,261.68 | 718,261.68 |
| 应付交易费用 | | | | | | 311,197.74 | 311,197.74 |
| 应交税费 | | | | | | 3,114,932.56 | 3,114,932.56 |
| 应付利息 | | | | | | 38,451.56 | 38,451.56 |
| 其他负债 | | | | | | 258,097.06 | 258,097.06 |
| 负债总计 | 980,000,000.00 | | | | | 14,089,303.94 | 994,089,303.94 |
| 利率敏感度缺口 | -756,344,925.86 | 340,600,900.90 | 1,454,887,374.00 | 2,797,562,200.00 | 113,872,000.00 | 170,404,979.62 | 4,120,982,528.66 |

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，并按照合同约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个基准点 | -14,229,002.18 | -23,931,998.52 |
| | -25个基准点 | 14,229,002.18 | 23,931,998.52 |

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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类债券、股票以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在每一个保本周期内，债券投资在资产配置中的比例不低于 60%，固定收益类金融产品和银行存款以外的资产在资产配置中的比例不高于 15%。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 | 212,697,342.66 | 6.05 | 112,092,762.19 | 2.72 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 3,937,028,591.40 | 111.93 | 4,030,116,574.00 | 97.80 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | 112,568,700.00 | 3.20 | — | — |
| 合计 | 4,262,294,634.06 | 121.18 | 4,142,209,336.19 | 100.52 |

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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 | 212,697,342.66 | 4.06 |
| | 其中：股票 | 212,697,342.66 | 4.06 |
| 2 | 固定收益投资 | 4,049,597,291.40 | 77.27 |
| | 其中：债券 | 3,937,028,591.40 | 75.12 |
| | 资产支持证券 | 112,568,700.00 | 2.15 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 99,900,349.85 | 1.91 |
| | 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 | 811,196,362.03 | 15.48 |
| 7 | 其他各项资产 | 67,338,475.79 | 1.28 |
| 8 | 合计 | 5,240,729,821.73 | 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 | 8,357,052.42 | 0.24 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 111,039,221.24 | 3.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 24,626,853.64 | 0.70 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 15,464,709.00 | 0.44 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,936,492.12 | 0.14 |
| J | 金融业 | 34,062,638.00 | 0.97 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,602,479.04 | 0.30 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,607,897.20 | 0.10 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|------|
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 212,697,342.66 | 6.05 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 000661 | 长春高新 | 174,506 | 22,530,469.66 | 0.64 |
| 2 | 601169 | 北京银行 | 1,906,000 | 17,478,020.00 | 0.50 |
| 3 | 000001 | 平安银行 | 1,766,200 | 16,584,618.00 | 0.47 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 616,621 | 13,312,847.39 | 0.38 |
| 5 | 600297 | 广汇汽车 | 1,617,288 | 12,178,178.64 | 0.35 |
| 6 | 600221 | 海航控股 | 3,640,800 | 11,723,376.00 | 0.33 |
| 7 | 600426 | 华鲁恒升 | 925,600 | 10,866,544.00 | 0.31 |
| 8 | 002241 | 歌尔股份 | 556,100 | 10,721,608.00 | 0.30 |
| 9 | 603228 | 景旺电子 | 220,901 | 10,658,473.25 | 0.30 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 770,529 | 10,602,479.04 | 0.30 |
| 11 | 000858 | 五粮液 | 166,100 | 9,245,126.00 | 0.26 |
| 12 | 000028 | 国药一致 | 103,600 | 8,381,240.00 | 0.24 |
| 13 | 000998 | 隆平高科 | 379,521 | 8,357,052.42 | 0.24 |
| 14 | 600096 | 云天化 | 1,057,700 | 7,826,980.00 | 0.22 |
| 15 | 002385 | 大北农 | 1,019,090 | 6,410,076.10 | 0.18 |
| 16 | 002195 | 二三四五 | 689,350 | 4,928,852.50 | 0.14 |
| 17 | 600329 | 中新药业 | 241,800 | 4,378,998.00 | 0.12 |
| 18 | 000566 | 海南海药 | 324,700 | 4,305,522.00 | 0.12 |
| 19 | 600337 | 美克家居 | 719,900 | 4,067,435.00 | 0.12 |
| 20 | 600079 | 人福医药 | 200,000 | 3,924,000.00 | 0.11 |
| 21 | 600794 | 保税科技 | 910,300 | 3,741,333.00 | 0.11 |
| 22 | 002341 | 新纶科技 | 195,500 | 3,646,075.00 | 0.10 |
| 23 | 000978 | 桂林旅游 | 389,600 | 3,607,696.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|--------|--------------|------|
| 24 | 603868 | 飞科电器 | 44,900 | 2,776,616.00 | 0.08 |
| 25 | 603238 | 诺邦股份 | 1,750 | 51,415.00 | 0.00 |
| 26 | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.00 |
| 27 | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.00 |
| 28 | 300666 | 江丰电子 | 2,276 | 43,448.84 | 0.00 |
| 29 | 300582 | 英飞特 | 2,038 | 38,558.96 | 0.00 |
| 30 | 002879 | 长缆科技 | 1,313 | 23,660.26 | 0.00 |
| 31 | 002881 | 美格智能 | 989 | 22,608.54 | 0.00 |
| 32 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | 0.00 |
| 33 | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | 0.00 |
| 34 | 002882 | 金龙羽 | 2,966 | 18,389.20 | 0.00 |
| 35 | 603933 | 睿能科技 | 857 | 17,311.40 | 0.00 |
| 36 | 603305 | 旭升股份 | 1,351 | 15,212.26 | 0.00 |
| 37 | 300669 | 沪宁股份 | 841 | 14,650.22 | 0.00 |
| 38 | 300670 | 大烨智能 | 1,259 | 13,760.87 | 0.00 |
| 39 | 603286 | 日盈电子 | 890 | 13,528.00 | 0.00 |
| 40 | 300672 | 国科微 | 1,257 | 10,659.36 | 0.00 |
| 41 | 603331 | 百达精工 | 999 | 9,620.37 | 0.00 |
| 42 | 300671 | 富满电子 | 942 | 7,639.62 | 0.00 |
| 43 | 603617 | 君禾股份 | 832 | 7,429.76 | 0.00 |
| 44 | 000069 | 华侨城 A | 20 | 201.20 | 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 | 000001 | 平安银行 | 19,246,292.00 | 0.47 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 19,154,948.10 | 0.46 |
| 3 | 601169 | 北京银行 | 17,572,443.55 | 0.43 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 11,416,886.45 | 0.28 |
| 5 | 002027 | 分众传媒 | 10,550,982.01 | 0.26 |
| 6 | 600426 | 华鲁恒升 | 10,548,992.91 | 0.26 |
| 7 | 603228 | 景旺电子 | 10,542,383.61 | 0.26 |
| 8 | 002241 | 歌尔股份 | 10,540,311.54 | 0.26 |
| 9 | 000028 | 国药一致 | 7,696,469.00 | 0.19 |
| 10 | 000978 | 桂林旅游 | 7,688,579.36 | 0.19 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 11 | 000858 | 五 粮 液 | 6,926,604.92 | 0.17 |
| 12 | 601952 | 苏垦农发 | 97,161.00 | 0.00 |
| 13 | 601878 | 浙商证券 | 93,364.05 | 0.00 |
| 14 | 603839 | 安正时尚 | 76,349.00 | 0.00 |
| 15 | 603980 | 吉华集团 | 59,322.80 | 0.00 |
| 16 | 603358 | 华达科技 | 55,157.42 | 0.00 |
| 17 | 300660 | 江苏雷利 | 47,479.74 | 0.00 |
| 18 | 603626 | 科森科技 | 47,049.60 | 0.00 |
| 19 | 603113 | 金能科技 | 46,741.52 | 0.00 |
| 20 | 002872 | 天圣制药 | 44,807.11 | 0.00 |

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 000661 | 长春高新 | 9,870,444.13 | 0.24 |
| 2 | 601111 | 中国国航 | 6,677,272.02 | 0.16 |
| 3 | 000001 | 平安银行 | 5,621,382.00 | 0.14 |
| 4 | 600079 | 人福医药 | 4,275,606.02 | 0.10 |
| 5 | 000978 | 桂林旅游 | 2,563,388.00 | 0.06 |
| 6 | 600977 | 中国电影 | 894,368.50 | 0.02 |
| 7 | 601997 | 贵阳银行 | 773,238.95 | 0.02 |
| 8 | 600909 | 华安证券 | 409,640.00 | 0.01 |
| 9 | 603858 | 步长制药 | 322,187.70 | 0.01 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 206,441.00 | 0.01 |
| 11 | 600936 | 广西广电 | 187,646.32 | 0.00 |
| 12 | 601878 | 浙商证券 | 183,029.14 | 0.00 |
| 13 | 601952 | 苏垦农发 | 174,840.25 | 0.00 |
| 14 | 603881 | 数据港 | 172,332.30 | 0.00 |
| 15 | 002831 | 裕同科技 | 154,821.50 | 0.00 |
| 16 | 600996 | 贵广网络 | 152,884.00 | 0.00 |
| 17 | 603626 | 科森科技 | 146,040.96 | 0.00 |
| 18 | 603817 | 海峡环保 | 138,422.60 | 0.00 |
| 19 | 603258 | 电魂网络 | 132,571.80 | 0.00 |
| 20 | 603900 | 通灵珠宝 | 130,454.40 | 0.00 |

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 | 133,538,886.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 39,758,838.13 |

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 | 187,505,487.90 | 5.33 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 395,450,000.00 | 11.24 |
| | 其中：政策性金融债 | 395,450,000.00 | 11.24 |
| 4 | 企业债券 | 1,503,576,900.00 | 42.75 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,527,512,500.00 | 43.43 |
| 6 | 中期票据 | 322,689,000.00 | 9.17 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 294,703.50 | 0.01 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,937,028,591.40 | 111.93 |

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 | 011698605 | 16 中粮 SCP007 | 2,000,000 | 200,620,000.00 | 5.70 |
| 2 | 011751024 | 17 邮政 SCP001 | 2,000,000 | 200,500,000.00 | 5.70 |
| 3 | 041769004 | 17 国家核电 CP001 | 2,000,000 | 200,240,000.00 | 5.69 |
| 4 | 018005 | 国开 1701 | 2,000,000 | 199,160,000.00 | 5.66 |
| 5 | 011753017 | 17 中电投 SCP005 | 1,500,000 | 150,240,000.00 | 4.27 |

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 | 1689069 | 16 龙元 1A2 | 3,000,000 | 33,060,000.00 | 0.94 |
| 2 | 1689066 | 16 速利银 丰 1A | 2,000,000 | 29,520,000.00 | 0.84 |
| 3 | 1689070 | 16 龙元 1B | 290,000 | 28,921,700.00 | 0.82 |
| 4 | 1689238 | 16 苏元 1A1 | 1,000,000 | 19,180,000.00 | 0.55 |
| 5 | 1689206 | 16 永生 2A1 | 100,000 | 1,887,000.00 | 0.05 |

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

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 | 95,153.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 13,710,317.41 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 53,531,629.47 |
| 5 | 应收申购款 | 1,374.97 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 67,338,475.79 |

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 |
| 30,492 | 114,133.51 | 908,449,815.17 | 26.10% | 2,571,709,101.12 | 73.90% |

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 | 1,472.38 | 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（2004年3月2日）基金份额总额 | 6,073,617,942.08 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,122,892,328.06 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,395,691.96 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 645,129,103.73 |
| 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 | 3,480,158,916.29 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期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

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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 |
|----------------------|------------|----------------|----------------------|-----------|----------------|----|
| 东北证券股 份有限公司 | 4 | 102,449,807.56 | 59.69% | 95,411.06 | 59.69% | - |
| 民生证券股 份有限公司 | 2 | 69,193,924.02 | 40.31% | 64,439.81 | 40.31% | - |
| 上海华信证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股 份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股 | 3 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 海通证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集 团股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股 份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 江海证券有 限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国民族证 券有限责任 公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个 交易单元 |
| 平安证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国融证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股 份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 新增 4 个 交易单元 |
| 西部证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|------------|
| 西南证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个交易单元 |
| 湘财证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易单元 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个交易单元 |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中原证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：（1）本基金本报告期末通过证券公司交易单元进行权证交易。

（2）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。

(3) 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 |
| 东北证券股份有限公司 | 811,616.38 | 0.09% | 273,900,000.00 | 0.33% | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 258,814,713.00 | 28.86% | 83,965,900,000.00 | 99.67% | - | - |
| 上海华信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|----------------|--------|---|---|---|---|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 广发证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集 团股份有限 公司 | 637,198,848.24 | 71.05% | - | - | - | - |
| 红塔证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有 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 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券有 限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国民族证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 国融证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------------|--|--|--|--|--|--|
| 股份有限公司 | | | | | | |
| 新时代证券 股份有限公司 | | | | | | |
| 安信证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 渤海证券股 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 | 《银华保本增值证券投资基金分红公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2017 年 1 月 4 日 |
| 3 | 《银华保本增值证券投资基金 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 |
| 4 | 《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 |
| 5 | 《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 |
| 6 | 《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 |
| 7 | 《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 |
| 8 | 《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 |
| 9 | 《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 |
| 10 | 《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 |

| | | | |
|----|--|----------------|-----------------|
| 11 | 《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经理人网站 | 2017 年 3 月 21 日 |
| 12 | 《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经理人网站 | 2017 年 3 月 31 日 |
| 13 | 《银华保本增值证券投资基金 2016 年年度报告》 | 本基金经理人网站 | 2017 年 3 月 31 日 |
| 14 | 《银华保本增值证券投资基金 2016 年年度报告摘要》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2017 年 3 月 31 日 |
| 15 | 《银华保本增值证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）》 | 本基金经理人网站 | 2017 年 4 月 15 日 |
| 16 | 《银华保本增值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经理人网站 | 2017 年 4 月 15 日 |
| 17 | 《银华保本增值证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》 | 三大证券报及本基金经理人网站 | 2017 年 4 月 21 日 |
| 18 | 《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经理人网站 | 2017 年 4 月 22 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经理人网站 | 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并参与其优惠费率活动的公告》 | 四大证券报及本基金经理人网站 | 2017 年 6 月 1 日 |
| 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经理人网站 | 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经理人网站 | 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017/03/03-2017/06/30 | 800,747,000.00 | - | - | 800,747,000.00 | 23.01% |

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

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保本增值证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华保本增值证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华保本增值证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华保本增值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办公场所。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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日