

银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资 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

§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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
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
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
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.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华生态环保主题灵活配置混合
基金主代码	001954
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 4 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	71,157,637.33 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过动态优选享受生态文明建设和节能环保领域快速发展的优质企业，通过优化风险收益配比来追求收益，以基金资产的长期稳定增值为最终目标。
投资策略	<p>本基金力图通过大类资产配置和精细化选股分享这一领域的成长红利。实际投资过程中，将“生态环保”作为大类资产配置的主要出发点，寻找适应这一发展方向的行业和企业；将“成长”作为自下而上选股的核心标准，深入分析公司商业模式创新性和可行性，跟踪公司商业规划的实施进度，选择战略清晰、执行力得到验证的优质上市公司重点投资。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于本基金定义的生态环保主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p>
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

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	《上海证券报》
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	-61,887.68
本期利润	-633,212.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0068
本期加权平均净值利润率	-0.65%
本期基金份额净值增长率	-1.06%
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	2,005,669.77
期末可供分配基金份额利润	0.0282
期末基金资产净值	73,163,307.10
期末基金份额净值	1.028
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	2.80%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

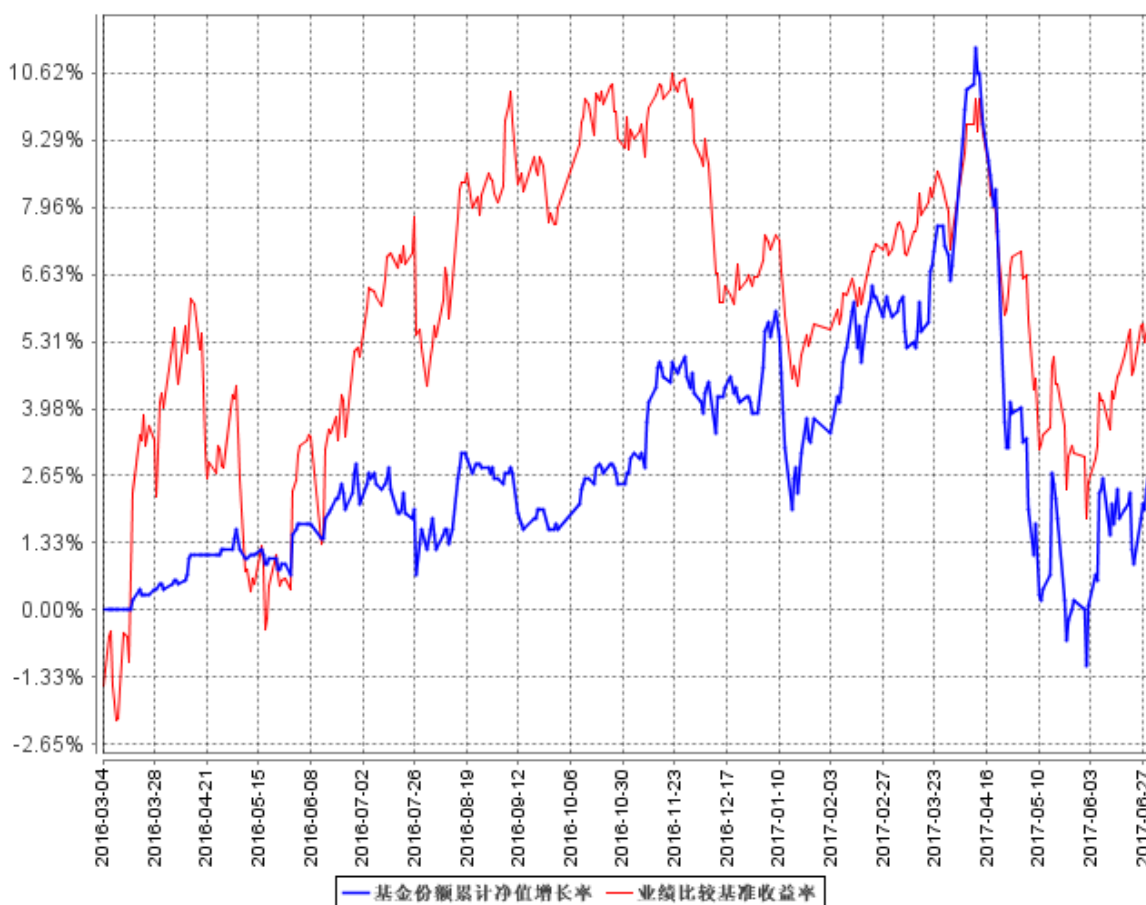
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.80%	0.71%	2.47%	0.52%	0.33%	0.19%
过去三个月	-3.75%	0.88%	-1.70%	0.60%	-2.05%	0.28%
过去六个月	-1.06%	0.71%	-0.95%	0.49%	-0.11%	0.22%
过去一年	0.29%	0.54%	0.38%	0.48%	-0.09%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.47%	5.58%	0.59%	-2.78%	-0.12%

注：中证环保产业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

中证环保产业指数是根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法，将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题，采用等权重加权方式，反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。中证全债指数是覆盖交易所债券市场和银行间债券市场两大市场国债、金融债及企业债整体走势的指数，具有更广的覆盖面，成分债券的流动性较高。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征和资产配置结构。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资比例为基金资产的0%-95%；投资于本基金定义的生态环保主题的证券不低于非现金基金资产的80%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

§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		
王海峰先生	本基金的基金经理	2016 年 3 月 4 日	-	9 年	硕士学位；2008 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，历任助理研究员、行业研究员、研究主管、投资经理助理等职务。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之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，生态环保基金紧密跟踪中证生态环保指数，择优挑选优质的环保公司进行投资。选股标准在于估值、业绩增速和公司的订单增速情况。

四月中旬以前，随着环保政策力度推进，以及环保公司一季报普遍较好，环保股整体走势较好，在 4 月份上半月，受益于雄安新区主题对环保股的估值推动作用，本基金在上半月表现较好。但是该主题迅速冷却，环保股出现了快速的估值下杀过程。此外，布局的深入介入环保领域的大型建筑企业也因为一带一路主题的崩塌，而跌幅较大。所以在 4 月份下旬，净值跌幅较大。五月及六月净值跟随大盘，先跌后涨，总体表现与中证环保指数持平。

纵观上半年，我们所持有的环保股，业绩稳步增长，只是估值水平受到市场风格的变化，股价出现了大幅的波动。而逐步涉足生态环保领域的大型建筑央企，也因为一带一路主题的行市，出现了明显的股价波动。基本面方面，环保和建筑类个股没有出现大幅超出或者低于市场预期的表现。

基于我们对中长期生态环保行业的看好，认为短期市场估值的波动不影响中长期的投资逻辑，所以我们承受估值波动对股价的影响，持有各子领域的龙头企业，赚取公司业绩持续增长的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金基金份额净值为 1.028 元，本报告期份额净值增长率为-1.06%，同期业绩比较基准收益率为-0.95%。

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，随着房地产限购政策的继续深化，相关产业链行业的影响逐步显现，但是由于经济整体的韧性较强，预计经济增速下行缓慢。三四季度有望见到利率高点。

市场整体可能依旧表现窄幅震荡的节奏。但是一旦利率上行预期开始扭转，压制泛环保股的两大因素（即资金成本上行和财政投资减弱）会消除，再加上目前环保公司通过 PPP 等形式，获取了较多的订单，未来两年业绩高增长无忧。

所以在利率没有出现拐点的时候，保持谨慎的权益比例，根据市场利率环境的变化，择机大幅提高环保企业的配置权重。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华生态环保主题灵活配置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“金融工具风险及管理”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：银华生态环保主题灵活配置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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	38,125,778.08	79,363,088.89
结算备付金		468,717.29	384,465.06
存出保证金		69,370.44	102,946.46
交易性金融资产	6.4.7.2	33,907,582.28	64,356,207.07
其中：股票投资		33,907,582.28	64,356,207.07
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	-	-
应收证券清算款		1,273,533.29	-
应收利息	6.4.7.5	6,099.21	19,611.81
应收股利		-	-
应收申购款		310,121.51	3,394.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		74,161,202.10	144,229,713.39
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		-	-
应付证券清算款		-	27,932,334.13
应付赎回款		349,704.61	224,077.46
应付管理人报酬		96,609.94	149,899.61
应付托管费		16,101.65	24,983.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	410,967.37	231,500.88

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	124,511.43	50,844.44
负债合计		997,895.00	28,613,639.81
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	71,157,637.33	111,227,769.89
未分配利润	6.4.7.10	2,005,669.77	4,388,303.69
所有者权益合计		73,163,307.10	115,616,073.58
负债和所有者权益总计		74,161,202.10	144,229,713.39

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.028 元，基金份额总额 71,157,637.33 份。

6.2 利润表

会计主体：银华生态环保主题灵活配置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 3 月 4 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		1,470,847.86	7,979,466.43
1.利息收入		122,031.21	925,836.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	122,031.21	410,650.68
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		-	515,186.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,817,400.81	5,128,574.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,525,829.09	4,987,982.62
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	291,571.72	140,591.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-571,324.43	1,402,582.95
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	102,740.27	522,472.28

减：二、费用		2,104,059.97	2,210,107.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	723,657.96	1,176,272.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	120,609.69	196,045.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,168,788.83	779,810.90
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	91,003.49	57,978.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-633,212.11	5,769,359.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-633,212.11	5,769,359.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华生态环保主题灵活配置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）	111,227,769.89	4,388,303.69	115,616,073.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-633,212.11	-633,212.11
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）	-40,070,132.56	-1,749,421.81	-41,819,554.37
其中：1.基金申购款	23,177,174.62	989,473.06	24,166,647.68
2.基金赎回款	-63,247,307.18	-2,738,894.87	-65,986,202.05
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)	71,157,637.33	2,005,669.77	73,163,307.10
项目	上年度可比期间 2016年3月4日(基金合同生效日)至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	318,720,131.87	-	318,720,131.87
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	5,769,359.03	5,769,359.03
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)	-144,031,985.66	-1,469,390.23	-145,501,375.89
其中:1.基金申购款	2,127,402.17	28,748.64	2,156,150.81
2.基金赎回款	-146,159,387.83	-1,498,138.87	-147,657,526.70
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)	174,688,146.21	4,299,968.80	178,988,115.01

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:

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>龚飒</u>
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

银华生态环保主题灵活配置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”)证监许可[2015]2164号《关于准予银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册,由银华基金管理股份有限公司于2015年12月28日至2016年2月26日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2016)验字第60468687_A04号验资报告后,向中国证监会报送基

金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集的有效净认购金额为人民币 318,631,241.72 元，折合 318,631,241.72 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 88,890.15 元，折合 88,890.15 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 318,720,131.87 元，折合 318,720,131.87 份基金份额。本基金的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。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于本基金定义的生态环保主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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本报告期末的财务状况以及本报告期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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无会计估计变更事项。

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	38,125,778.08
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	38,125,778.08

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	34,526,876.78	33,907,582.28	-619,294.50
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		34,526,876.78	33,907,582.28	-619,294.50

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	5,857.96
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	209.02
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.03
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	31.20
合计	6,099.21

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	410,967.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	410,967.37

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	127.67
预提费用	124,383.76
合计	124,511.43

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	111,227,769.89	111,227,769.89
本期申购	23,177,174.62	23,177,174.62
本期赎回(以“-”号填列)	-63,247,307.18	-63,247,307.18
- 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	71,157,637.33	71,157,637.33

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	4,893,612.30	-505,308.61	4,388,303.69
本期利润	-61,887.68	-571,324.43	-633,212.11
本期基金份额交易产生的变动数	-2,287,603.23	538,181.42	-1,749,421.81
其中：基金申购款	1,236,227.10	-246,754.04	989,473.06

基金赎回款	-3,523,830.33	784,935.46	-2,738,894.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,544,121.39	-538,451.62	2,005,669.77

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	116,055.92
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	4,865.21
其他	1,110.08
合计	122,031.21

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	395,949,345.37
减：卖出股票成本总额	394,423,516.28
买卖股票差价收入	1,525,829.09

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	291,571.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	291,571.72

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	-571,324.43
——股票投资	-571,324.43
——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	-571,324.43

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	98,853.80
转换费收入	3,886.47
合计	102,740.27

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	1,168,788.83
银行间市场交易费用	-

合计	1,168,788.83
----	--------------

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	24,795.19
信息披露费	49,588.57
债券账户维护费	9,000.00
银行费用	7,219.73
其他	400.00
合计	91,003.49

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月4日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西南证券	462,478,901.29	60.81%	290,517,297.71	53.49%
第一创业证券	6,781,150.00	0.89%	-	-

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3月4日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
西南证券	-	-	510,800,000.00	11.28%

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
西南证券	430,705.92	61.06%	282,059.46	68.63%
第一创业证券	6,315.10	0.90%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2016年3月4日(基金合同生效日)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	270,559.07	54.09%	216,386.49	49.59%

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3月4日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	723,657.96	1,176,272.33
其中：支付销售机构的客户维护费	181,238.98	342,231.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财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3月4日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	120,609.69	196,045.37

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致

后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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 3 月 4 日(基金合同生效日)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	38,125,778.08	116,055.92	84,933,425.17

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：本基金本报告期未在承销期参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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	停牌	停	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总额	备注
------	----	----	---	----	----	----	-------	----	--------	----

码	名称	日期	牌原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额		
601989	中国重工	2017年5月31日	重大事项	6.21	-	-	296,300	1,873,416.00	1,840,023.00	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项	5.16	-	-	180,600	1,002,330.00	931,896.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基本资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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较小；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、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	38,125,778.08	-	-	-	-	-	38,125,778.08
结算备付金	468,717.29	-	-	-	-	-	468,717.29
存出保证金	69,370.44	-	-	-	-	-	69,370.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-33,907,582.28	33,907,582.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-1,273,533.29	1,273,533.29
应收利息	-	-	-	-	-	6,099.21	6,099.21
应收申购款	-	-	-	-	-	310,121.51	310,121.51

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,663,865.81	-	-	-	-	-35,497,336.29	74,161,202.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	349,704.61	349,704.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	96,609.94	96,609.94
应付托管费	-	-	-	-	-	16,101.65	16,101.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	410,967.37	410,967.37
其他负债	-	-	-	-	-	124,511.43	124,511.43
负债总计	-	-	-	-	-	997,895.00	997,895.00
利率敏感度缺口	38,663,865.81	-	-	-	-	-34,499,441.29	73,163,307.10
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	79,363,088.89	-	-	-	-	-	79,363,088.89
结算备付金	384,465.06	-	-	-	-	-	384,465.06
存出保证金	102,946.46	-	-	-	-	-	102,946.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-64,356,207.07	64,356,207.07
应收利息	-	-	-	-	-	19,611.81	19,611.81
应收申购款	-	-	-	-	-	3,394.10	3,394.10
资产总计	79,850,500.41	-	-	-	-	-64,379,212.98	144,229,713.39
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-27,932,334.13	27,932,334.13
应付赎回款	-	-	-	-	-	224,077.46	224,077.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	149,899.61	149,899.61
应付托管费	-	-	-	-	-	24,983.29	24,983.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	231,500.88	231,500.88
其他负债	-	-	-	-	-	50,844.44	50,844.44
负债总计	-	-	-	-	-	-28,613,639.81	28,613,639.81
利率敏感度缺口	79,850,500.41	-	-	-	-	-35,765,573.17	115,616,073.58

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：本基金在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。

在资产类别配置上，基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于本基金定义的生态环保主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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	33,907,582.28	46.35	64,356,207.07	55.66
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	33,907,582.28	46.35	64,356,207.07	55.66

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。		
	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）	
分析		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	3,112,204.32	1,327,637.07
	-5%	-3,112,204.32	-1,327,637.07

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，本基金并无需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	33,907,582.28	45.72
	其中：股票	33,907,582.28	45.72
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	38,594,495.37	52.04
7	其他各项资产	1,659,124.45	2.24
8	合计	74,161,202.10	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	1,475,880.00	2.02
B	采矿业	2,141,050.00	2.93
C	制造业	11,253,981.75	15.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,976,891.00	5.44
E	建筑业	1,812,448.00	2.48
F	批发和零售业	2,965,087.44	4.05
G	交通运输、仓储和邮政业	3,733,473.09	5.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	898,383.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,650,388.00	7.72
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	33,907,582.28	46.35

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	000553	沙隆达 A	358,916	4,967,397.44	6.79
2	002573	清新环境	128,200	2,412,724.00	3.30
3	600270	外运发展	106,533	2,016,669.69	2.76
4	600388	龙净环保	129,500	2,011,135.00	2.75
5	601989	中国重工	296,300	1,840,023.00	2.51
6	002310	东方园林	108,400	1,812,448.00	2.48
7	000711	京蓝科技	98,000	1,475,880.00	2.02
8	000598	兴蓉环境	258,000	1,449,960.00	1.98
9	000968	*ST 煤气	98,800	1,428,648.00	1.95
10	000826	启迪桑德	39,200	1,376,704.00	1.88
11	600863	内蒙华电	427,900	1,287,979.00	1.76
12	600578	京能电力	288,800	1,238,952.00	1.69
13	600755	厦门国贸	124,137	1,132,129.44	1.55
14	000888	峨眉山 A	88,800	1,127,760.00	1.54
15	000417	合肥百货	135,260	1,115,895.00	1.53
16	000709	河钢股份	239,549	1,003,710.31	1.37
17	601872	招商轮船	180,600	931,896.00	1.27
18	002183	怡亚通	104,100	898,383.00	1.23
19	002352	顺丰控股	14,765	784,907.40	1.07
20	000786	北新建材	46,900	742,896.00	1.02
21	603199	九华旅游	18,800	733,200.00	1.00

22	600546	山煤国际	149,700	717,063.00	0.98
23	601699	潞安环能	91,100	712,402.00	0.97
24	300362	天翔环境	40,400	688,820.00	0.94

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	000905	厦门港务	7,945,564.00	6.87
2	601800	中国交建	7,892,336.00	6.83
3	600270	外运发展	7,079,012.83	6.12
4	002307	北新路桥	6,886,175.76	5.96
5	600115	东方航空	6,800,117.00	5.88
6	002352	顺丰控股	6,777,818.09	5.86
7	600068	葛洲坝	6,356,886.02	5.50
8	601117	中国化学	6,256,694.75	5.41
9	601699	潞安环能	5,960,049.72	5.16
10	600967	内蒙一机	5,488,745.00	4.75
11	002310	东方园林	5,279,951.00	4.57
12	000937	冀中能源	5,250,347.00	4.54
13	601186	中国铁建	5,094,934.00	4.41
14	603993	洛阳钼业	4,783,963.00	4.14
15	000553	沙隆达 A	4,679,731.00	4.05
16	603799	华友钴业	4,503,152.00	3.89
17	600388	龙净环保	4,457,982.00	3.86
18	600486	扬农化工	4,385,694.54	3.79
19	601111	中国国航	4,286,974.00	3.71
20	600428	中远海特	4,002,423.00	3.46
21	600197	伊力特	3,955,190.00	3.42
22	000709	河钢股份	3,856,729.00	3.34
23	600233	圆通速递	3,820,303.87	3.30
24	600977	中国电影	3,797,638.44	3.28
25	601669	中国电建	3,744,797.00	3.24
26	600612	老凤祥	3,689,312.26	3.19

27	600027	华电国际	3,549,200.40	3.07
28	601668	中国建筑	3,484,471.00	3.01
29	600795	国电电力	3,445,476.00	2.98
30	600886	国投电力	3,391,031.18	2.93
31	601989	中国重工	3,284,568.00	2.84
32	000401	冀东水泥	3,283,373.00	2.84
33	600029	南方航空	3,249,934.00	2.81
34	000753	漳州发展	3,100,257.27	2.68
35	600110	诺德股份	3,087,385.00	2.67
36	600491	龙元建设	3,079,656.00	2.66
37	601857	中国石油	3,033,874.00	2.62
38	600863	内蒙华电	3,011,660.00	2.60
39	000826	启迪桑德	2,989,426.00	2.59
40	000615	京汉股份	2,980,938.00	2.58
41	600887	伊利股份	2,973,834.00	2.57
42	000538	云南白药	2,953,076.00	2.55
43	300156	神雾环保	2,871,261.00	2.48
44	002391	长青股份	2,867,213.20	2.48
45	600755	厦门国贸	2,807,223.00	2.43
46	300327	中颖电子	2,757,229.00	2.38
47	600909	华安证券	2,725,290.00	2.36
48	002120	韵达股份	2,722,687.00	2.35
49	600681	百川能源	2,665,275.00	2.31
50	600153	建发股份	2,663,369.00	2.30
51	300362	天翔环境	2,561,489.65	2.22
52	600125	铁龙物流	2,503,593.00	2.17
53	002573	清新环境	2,399,281.00	2.08
54	000711	京蓝科技	2,376,196.00	2.06
55	600075	新疆天业	2,345,715.00	2.03
56	300203	聚光科技	2,335,227.00	2.02
57	002250	联化科技	2,313,409.31	2.00

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	601800	中国交建	7,971,798.80	6.90
2	000905	厦门港务	7,953,700.00	6.88
3	002307	北新路桥	7,208,495.00	6.23
4	600115	东方航空	6,944,401.16	6.01
5	601117	中国化学	6,674,034.10	5.77
6	002352	顺丰控股	6,616,392.05	5.72
7	600068	葛洲坝	6,185,674.70	5.35
8	600486	扬农化工	5,631,919.05	4.87
9	600967	内蒙一机	5,525,104.65	4.78
10	601699	潞安环能	5,394,238.10	4.67
11	000937	冀中能源	5,373,758.92	4.65
12	600270	外运发展	5,281,914.29	4.57
13	600428	中远海特	5,007,269.00	4.33
14	601186	中国铁建	4,847,549.00	4.19
15	603993	洛阳钼业	4,751,767.00	4.11
16	603799	华友钴业	4,640,786.66	4.01
17	000615	京汉股份	4,521,616.00	3.91
18	601111	中国国航	4,344,010.00	3.76
19	600197	伊力特	4,239,484.00	3.67
20	000820	神雾节能	4,226,930.98	3.66
21	002391	长青股份	4,188,349.56	3.62
22	300070	碧水源	4,162,580.00	3.60
23	000711	京蓝科技	4,094,870.79	3.54
24	300197	铁汉生态	4,052,419.81	3.51
25	600977	中国电影	3,945,376.75	3.41
26	600233	圆通速递	3,939,372.46	3.41
27	000826	启迪桑德	3,846,564.90	3.33
28	600612	老凤祥	3,769,111.22	3.26
29	601669	中国电建	3,755,830.00	3.25
30	002140	东华科技	3,696,293.74	3.20
31	600886	国投电力	3,531,321.02	3.05
32	002310	东方园林	3,520,970.29	3.05
33	600027	华电国际	3,498,165.99	3.03
34	600795	国电电力	3,468,404.00	3.00
35	601668	中国建筑	3,448,689.00	2.98
36	600029	南方航空	3,369,772.00	2.91

37	600518	康美药业	3,322,321.80	2.87
38	000401	冀东水泥	3,262,297.43	2.82
39	000753	漳州发展	3,131,189.00	2.71
40	600110	诺德股份	3,124,777.80	2.70
41	000975	银泰资源	3,034,301.00	2.62
42	600491	龙元建设	3,032,404.97	2.62
43	600498	烽火通信	3,030,579.00	2.62
44	600502	安徽水利	3,013,193.91	2.61
45	600887	伊利股份	2,956,833.00	2.56
46	601857	中国石油	2,905,545.18	2.51
47	000709	河钢股份	2,789,853.14	2.41
48	600153	建发股份	2,754,042.00	2.38
49	000538	云南白药	2,708,069.00	2.34
50	600681	百川能源	2,675,195.25	2.31
51	600008	首创股份	2,634,373.00	2.28
52	300156	神雾环保	2,627,775.90	2.27
53	600125	铁龙物流	2,587,817.00	2.24
54	002120	韵达股份	2,540,290.00	2.20
55	600909	华安证券	2,531,044.00	2.19
56	600963	岳阳林纸	2,521,552.00	2.18
57	300327	中颖电子	2,482,229.50	2.15
58	600388	龙净环保	2,456,868.00	2.13
59	601899	紫金矿业	2,416,153.00	2.09
60	600798	宁波海运	2,396,453.00	2.07
61	000598	兴蓉环境	2,366,445.00	2.05
62	002250	联化科技	2,354,811.91	2.04
63	600075	新疆天业	2,340,748.00	2.02
64	002202	金风科技	2,314,980.00	2.00

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	364,546,215.92
卖出股票收入（成交）总额	395,949,345.37

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	69,370.44
2	应收证券清算款	1,273,533.29
3	应收股利	-
4	应收利息	6,099.21
5	应收申购款	310,121.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,659,124.45

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601989	中国重工	1,840,023.00	2.51	重大事项

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
3,479	20,453.47	14,818,950.00	20.83%	56,338,687.33	79.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	23,520.26	0.03%

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（2016年3月4日）基金份额总额	318,720,131.87
本报告期期初基金份额总额	111,227,769.89
本报告期基金总申购份额	23,177,174.62
减：本报告期基金总赎回份额	63,247,307.18
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	71,157,637.33

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

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
西南证券股 份有限公司	2	462,478,901.29	60.81%	430,705.92	61.06%	-
招商证券股 份有限公司	2	54,719,633.34	7.20%	50,960.42	7.22%	-
东北证券股 份有限公司	2	44,855,760.27	5.90%	41,774.43	5.92%	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	38,181,318.72	5.02%	35,557.68	5.04%	-
方正证券股 份有限公司	2	36,546,120.64	4.81%	34,035.10	4.83%	-
国金证券股 份有限公司	1	31,162,137.72	4.10%	29,021.30	4.11%	-
中信证券股 份有限公司	3	23,391,196.80	3.08%	21,784.13	3.09%	-
国信证券股 份有限公司	2	16,288,165.54	2.14%	15,169.29	2.15%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	12,275,247.41	1.61%	11,431.86	1.62%	-
中天证券有 限责任公司	1	10,450,692.72	1.37%	9,732.59	1.38%	-
川财证券有 限责任公司	2	7,581,709.00	1.00%	5,544.47	0.79%	-
财富证券股 份有限公司	1	6,784,508.00	0.89%	4,961.46	0.70%	新增 1 个 交易单元
第一创业证 券股份有限 公司	1	6,781,150.00	0.89%	6,315.10	0.90%	-
华泰证券股 份有限公司	1	5,712,513.84	0.75%	5,320.07	0.75%	-
中国银河证 券股份有限 公司	3	3,286,506.00	0.43%	3,060.68	0.43%	-
平安证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期基金租用证券公司交易单元未进行除股票以外的其他证券投资。

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	《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第四季度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2017 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
4	《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
5	《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
6	《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
7	《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	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 21 日

	率优惠活动的公告》		
8	《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
9	《银华生态环保主题灵活配置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
10	《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	上海证券报及本基金管理人网站	2017年3月31日
11	《银华生态环保主题灵活配置混合型基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2017年4月18日
12	《银华生态环保主题灵活配置混合型基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号）》	上海证券报及本基金管理人网站	2017年4月18日
13	《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2017年4月21日
14	《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
15	《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
16	《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
17	《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管理人网站	2017年6月1日
18	《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
19	《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

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	2017/01/01- 2017/06/30	30,000,200 .00	9,468,750. 00	24,650,000 .00	14,818,950 .00	20.83 %

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 银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华生态环保主题灵活配置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

12.2 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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017年8月29日