

# 银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	63

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华-道琼斯 88 精选证券投资基金
基金简称	银华-道琼斯 88 指数
基金主代码	180003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 8 月 11 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	2,386,338,470.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将运用增强型指数化投资方法，通过严格的投资流程和数量化风险管理，在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数基金，以道琼斯中国 88 指数为基金投资组合跟踪的标的指数，股票指数化投资部分主要投资于标的指数的成份股票，增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票，在控制与标的指数偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益率。</p> <p>本基金将不高于 75% 的资产投资于股票，将不低于 20% 的资产投资于国债。且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。在法律环境允许后，本基金股票资产投资比例上限将调整为 95%。</p>
业绩比较基准	道琼斯中国 88 指数收益率
风险收益特征	<p>1、与标的指数偏离的风险揭示：本基金采用的增强性投资策略将产生跟踪误差，基金的风险特征可能有别于指数本身。</p> <p>2、基金价格变动风险提示：本基金因股票资产投资比例较大，当所追踪之标的指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金资产净值的相应下跌，产生跌破基金发行价的风险。</p> <p>3、更换标的指数风险提示：本基金管理人在本招募说明书规定的特定情况下有权更换标的指数，由此可能产生风险。</p>

### 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	tianqing1.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	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

### 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

### §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	268,122,148.48
本期利润	315,831,362.08
加权平均基金份额本期利润	0.1282
本期加权平均净值利润率	12.69%
本期基金份额净值增长率	13.42%
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	215,149,455.61
期末可供分配基金份额利润	0.0902
期末基金资产净值	2,601,487,926.48
期末基金份额净值	1.0902
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	359.63%

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

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.51%	0.63%	5.12%	0.76%	0.39%	-0.13%
过去三个月	7.41%	0.59%	9.26%	0.70%	-1.85%	-0.11%
过去六个月	13.42%	0.52%	13.68%	0.61%	-0.26%	-0.09%
过去一年	20.17%	0.62%	19.85%	0.69%	0.32%	-0.07%
过去三年	53.88%	1.57%	71.47%	1.76%	-17.59%	-0.19%
自基金合同	359.63%	1.54%	149.21%	1.79%	210.42%	-0.25%



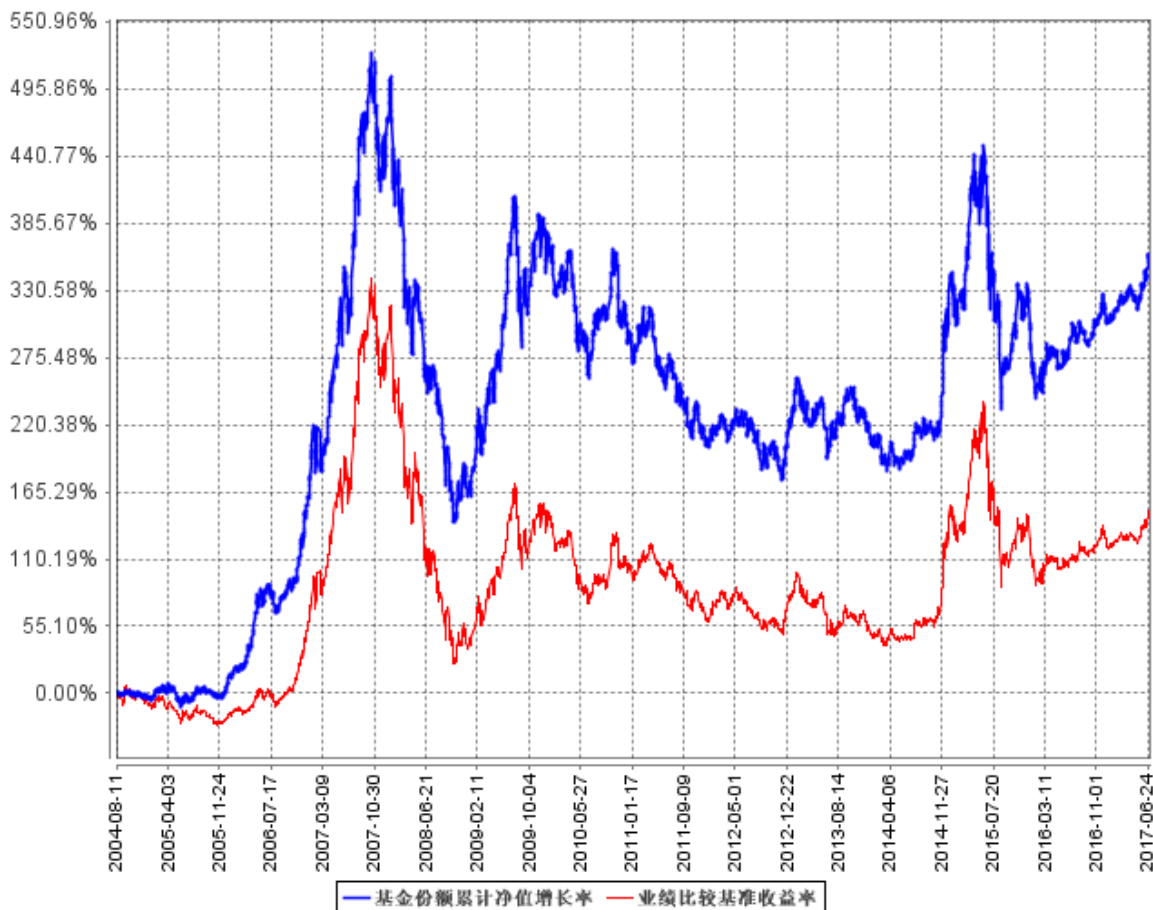
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金以道琼斯中国 88 指数（简称道中 88 指数）为标的指数。

道中 88 指数是第一个由全球指数编制机构道琼斯公司为中國大陸股票市场编制的指数，由道琼斯中国指数中按照自由流通市值和交易流动性综合排名的前 88 名家上市公司构成。为了准确代表投资者可实际交易的股票数量，道中 88 指数为挑选成份股而计算自由流通股本时，排除了持股超过整个市值 5% 的个人、其它公司以及政府持有的股份。道中 88 指数每季度进行一次成份股的调整，同时道中 88 指数成份股缓冲区的建立将适当保证道中 88 指数具有较低的指数换股率。

### 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三个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金将不高于 95% 的资产投资于股票，且保持不低于基金资产 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		
刘辉先生	本基金的基金经理	2017 年 3 月 15 日	-	16.5 年	博士学位。曾就职于中信证券股份有限公司、中信基金管理有限公司、北京嘉数资产管理有限公司，从事投资研究工作。2016 年 11 月加入银华基金管理股份有限公司，现任职于投资管理一部。自 2017 年 3 月 15 日起担任银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

陈秀峰先生	本基金的基金经理	2010年9月8日	2017年3月17日	15年	硕士学位。曾先后任职于中国民族国际信托投资公司、中国信息信托投资公司。2002年8月至2017年4月任职于银华基金管理股份有限公司，历任基金经理助理、投资部总监助理、投资部执行总监、机构理财部负责人、企业年金与机构理财部总监、特定资产管理部总监。具有从业资格。国籍：中国。
-------	----------	-----------	------------	-----	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华-道琼斯 88 精选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 1 季度，在工业补库存行为的推动下，PPI 当月同比增速创出近几年的新高，经济数据向好，周期行业盈利大幅改善。2 季度经济韧性较强，虽然同比增速较 1 季度有所降低，但总体运行平稳。流动性方面，央行维持资金面紧平衡，银监会对于同业、非标业务的治理力度加强，金融监管从严，叠加联储加息预期，使得利率水平出现一定幅度上行。同时，房地产等领域的信贷管控较为严格，新增信贷增速回落。随着金融监管协调的加强，以及央行及时释放流动性，利率水平企稳并略有回落。

上半年证券市场整体呈现宽幅震荡和剧烈分化。截至 2017 年 6 月 30 日，上证 50、上证综指、中小板指、创业板指年初以来涨幅分别为 11.5%、2.86%、7.33%、-7.34%。可以看出，蓝筹股估值的缓慢上移与中小创估值的缓慢下行仍在持续，市场偏好回归价值投资本质。以盈利确定性好、行业处于上行拐点、低估值为特征的板块，如家电、食品饮料等，表现领先。受益于供给侧改革或环保趋严的周期行业，也表现较好。不同板块之间的表现呈现出较大的结构性差异，这一切都对投资过程中板块与个股的选取提出了更高要求。

本基金在上半年的操作中，维持了中性仓位比例。在一季度末，道琼斯中国 88 指数进行了成份股的调整。相应地，本基金对持仓中的品种进行了调换，增加了金融板块的持仓，更好的跟踪基准的变化方向。同时不断优化积极投资部分，配置各个行业的龙头白马，获得了较好的收益。

### 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 1.0902 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.42%，业

绩比较基准收益率为 13.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，本基金认为中国经济仍然具有长期的增长潜力，下半年经济大概率会延续逐季下行趋势，但经济韧性仍在。证券市场会延续上半年震荡分化的格局，作为风险偏好的延续，蓝筹与行业龙头仍将是市场资金配置的重点方向。同时考虑到部分一线个股与行业涨幅较大，绩优二线蓝筹与成长股可能会成为新的资金配置热点。本基金在下半年预计仍将维持中性仓位，在积极投资部分加强个股研究与筛选，力争获得更好的相对收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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-道琼斯 88 精选证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	138,977,859.01	307,555,487.08
结算备付金		10,904,220.17	-
存出保证金		204,235.50	212,574.52
交易性金融资产	6.4.7.2	2,320,731,166.30	2,125,825,355.16
其中：股票投资		2,320,731,166.30	1,826,265,355.16
基金投资		-	-
债券投资		-	299,560,000.00
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		140,083,982.54	-
应收利息	6.4.7.5	-4,400.19	5,233,869.04
应收股利		-	-
应收申购款		54,627.65	116,891.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	233.25	233.25
资产总计		2,610,951,924.23	2,438,944,410.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,199,339.47	1,548,860.26
应付管理人报酬		2,500,093.03	2,519,405.39
应付托管费		520,852.72	524,876.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,698,745.25	135,541.33



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	544,967.28	451,128.88
负债合计		9,463,997.75	5,179,811.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,386,338,470.87	2,532,028,272.82
未分配利润	6.4.7.10	215,149,455.61	-98,263,674.27
所有者权益合计		2,601,487,926.48	2,433,764,598.55
负债和所有者权益总计		2,610,951,924.23	2,438,944,410.53

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0902 元，基金份额总额为 2,386,338,470.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		338,960,860.80	-227,382,872.87
1.利息收入		3,698,320.52	3,576,128.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	914,124.00	903,007.45
债券利息收入		2,208,849.31	2,673,120.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		575,347.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		287,531,952.02	23,030,001.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	268,273,574.31	-152,841.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	138,500.00	51,800.00
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	19,119,877.71	23,131,042.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	47,709,213.60	-254,005,254.12
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	21,374.66	16,251.87
<b>减：二、费用</b>		23,129,498.72	17,157,067.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,797,381.59	14,015,782.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,082,787.93	2,919,954.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,031,928.70	6,149.78
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	217,400.50	215,180.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		315,831,362.08	-244,539,940.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		315,831,362.08	-244,539,940.52

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

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）	2,532,028,272.82	-98,263,674.27	2,433,764,598.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	315,831,362.08	315,831,362.08
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）	-145,689,801.95	-2,418,232.20	-148,108,034.15
其中：1.基金申购款	32,396,137.79	334,766.56	32,730,904.35
2.基金赎回款	-178,085,939.74	-2,752,998.76	-180,838,938.50
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)	2,386,338,470.87	215,149,455.61	2,601,487,926.48
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
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,673,328,246.78	-3,467,443.01	2,669,860,803.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-244,539,940.52	-244,539,940.52
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)	-28,957,853.03	2,654,950.92	-26,302,902.11
其中: 1.基金申购款	51,491,907.48	-6,346,641.28	45,145,266.20
2.基金赎回款	-80,449,760.51	9,001,592.20	-71,448,168.31
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)	2,644,370,393.75	-245,352,432.61	2,399,017,961.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王立新	凌宇翔	龚飒
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华-道琼斯 88 精选证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]82 号文《关于同意银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的批复》的核准,由银华基金管理股份有限公司于 2004 年 7 月 5 日至 2004 年 8 月 5 日向社会公开发行募集,基金合同于 2004 年 8 月 11 日正式生效,首次设立募集规模为 1,085,604,444.01 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人

和注册登记机构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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括道琼斯中国 88 指数的成份 A 股及其备选成份股、新股（首发或增发）、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债等债券资产）以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。在资产类别配置上，本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的股票选择主要依据入选道琼斯中国 88 指数的成份股和备选成份股，且对标的指数成份股的投资不少于 62 只，对标的指数成份股以外的股票投资不高于股票投资资产总额的 40%。本基金以道琼斯中国 88 指数为标的指数，但基金管理人可以按照本基金合同规定的程序变更标的指数。本基金的业绩比较基准与标的指数的定义相同。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项。

### 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	138,977,859.01
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	138,977,859.01

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,056,004,482.62	2,320,731,166.30	264,726,683.68
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,056,004,482.62	2,320,731,166.30	264,726,683.68

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金于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：本基金于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：本基金于本报告期末无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	48,416.28
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	4,906.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-57,882.76
应收申购款利息	67.49
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	91.90
合计	-4,400.19

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	233.25
待摊费用	-
合计	233.25

**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	2,698,745.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,698,745.25

#### 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	1,569.44
其他应付款其他	260,001.15
预提费用	283,396.69
合计	544,967.28

#### 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	2,532,028,272.82	2,532,028,272.82
本期申购	32,396,137.79	32,396,137.79
本期赎回(以“-”号填列)	-178,085,939.74	-178,085,939.74
- 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	2,386,338,470.87	2,386,338,470.87

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	410,826,992.53	-509,090,666.80	-98,263,674.27
本期利润	268,122,148.48	47,709,213.60	315,831,362.08
本期基金份额交易产生的变动数	-30,815,355.96	28,397,123.76	-2,418,232.20

其中：基金申购款	6,877,244.89	-6,542,478.33	334,766.56
基金赎回款	-37,692,600.85	34,939,602.09	-2,752,998.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	648,133,785.05	-432,984,329.44	215,149,455.61

#### 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	868,408.91
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	44,413.23
其他	1,301.86
合计	914,124.00

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,627,924,000.94
减：卖出股票成本总额	1,359,650,426.63
买卖股票差价收入	268,273,574.31

#### 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	138,500.00
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	138,500.00

**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	307,390,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	299,861,500.00
减：应收利息总额	7,390,000.00
买卖债券差价收入	138,500.00

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无申购差价收入。

**6.4.7.13.5 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	19,119,877.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,119,877.71

**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	47,709,213.60
——股票投资	47,407,713.60
——债券投资	301,500.00
——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	47,709,213.60

#### 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	20,506.41
转换费	868.25
合计	21,374.66

#### 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	5,031,928.70
银行间市场交易费用	-
合计	5,031,928.70

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	5,403.81
账户服务费	18,600.00
合计	217,400.50

## 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无发生变化的情况。

### 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
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
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
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

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券	65,198,284.17	1.90%
第一创业	309,984,854.58	9.03%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东北证券	440,000,000.00	9.63%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	60,444.67	1.95%	60,719.36	2.25%
第一创业	288,690.33	9.31%	-	-

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

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

3、本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**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	14,797,381.59	14,015,782.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,997,150.83	1,961,710.03

注：基金管理费按前一日基金资产净值的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五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	3,082,787.93	2,919,954.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	138,977,859.01	868,408.91	242,392,099.95	902,798.01

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600559	老白干酒	2017 年 1 月 23 日	重大事项	28.44	-	-	2,900,000	51,933,379.53	82,476,000.00	-
601989	中国重工	2017 年	重大	6.21	-	-	2,797,697	19,043,538.40	17,373,698.37	-



		5月31日	事项								
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	3,159,500	10,543,634.95	11,374,200.00	-	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43		2017年7月26日	3.72	2,394,923	8,029,960.65	8,214,585.89	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项	14.98	-	-	456,400	6,402,682.56	6,836,872.00	-	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大事项	14.12	-	-	454,557	6,655,264.93	6,418,344.84	-	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事项	24.93	-	-	183,600	6,652,218.00	4,577,148.00	-	-
002127	南极电商	2017年6月29日	重大事项	12.08		2017年7月6日	12.61	286,600	3,350,872.77	3,462,128.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	23.48	-	-	53,700	1,063,112.00	1,260,876.00	-	-
002567	唐人神	2017年6月5日	重大事项	10.33	-	-	73,987	775,452.27	764,285.71	-	-
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事项	7.57		2017年7月3日	7.54	10,000	117,000.00	75,700.00	-
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项	7.47	-	-	10,000	42,786.22	74,700.00	-	-

### 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

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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。本基金的生息资产主要为银行存款、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	138,977,859.01	-	-	-	-	-	138,977,859.01
结算备付金	10,904,220.17	-	-	-	-	-	10,904,220.17
存出保证金	204,235.50	-	-	-	-	-	204,235.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,320,731,166.30	-2,320,731,166.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	140,083,982.54	140,083,982.54
应收利息	-	-	-	-	-	-4,400.19	-4,400.19
应收申购款	-	-	-	-	-	54,627.65	54,627.65
其他资产	-	-	-	-	-	233.25	233.25
资产总计	150,086,314.68	-	-	-	-	-2,460,865,609.55	2,610,951,924.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,199,339.47	3,199,339.47

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,500,093.03	2,500,093.03
应付托管费	-	-	-	-	-	520,852.72	520,852.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,698,745.25	2,698,745.25
其他负债	-	-	-	-	-	544,967.28	544,967.28
负债总计	-	-	-	-	-	9,463,997.75	9,463,997.75
利率敏感度缺口	150,086,314.68	-	-	-	-	-2,451,401,611.80	2,601,487,926.48
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	307,555,487.08	-	-	-	-	-	307,555,487.08
存出保证金	212,574.52	-	-	-	-	-	212,574.52
交易性金融资产	-99,900,000.00	199,660,000.00	-	-	-	-1,826,265,355.16	162,125,825,355.16
应收利息	-	-	-	-	-	5,233,869.04	5,233,869.04
应收申购款	994.04	-	-	-	-	115,897.44	116,891.48
其他资产	-	-	-	-	-	233.25	233.25
资产总计	307,769,055.64	99,900,000.00	199,660,000.00	-	-	-1,831,615,354.89	2,438,944,410.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,548,860.26	1,548,860.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,519,405.39	2,519,405.39
应付托管费	-	-	-	-	-	524,876.12	524,876.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	135,541.33	135,541.33
其他负债	-	-	-	-	-	451,128.88	451,128.88
负债总计	-	-	-	-	-	5,179,811.98	5,179,811.98
利率敏感度缺口	307,769,055.64	99,900,000.00	199,660,000.00	-	-	-1,826,435,542.91	2,433,764,598.55

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 个基点	-	-225,965.84
	-25 个基点	-	225,965.84

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

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，本基金将不高于 95% 的资产投资于股票，且保持不低于基金资产 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	2,320,731,166.30	89.21	1,826,265,355.16	75.04
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	299,560,000.00	12.31
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,320,731,166.30	89.21	2,125,825,355.16	87.35

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	106,455,320.79	105,051,930.10
	-5%	-106,455,320.79	-105,051,930.10

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,320,731,166.30	88.88
	其中：股票	2,320,731,166.30	88.88
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	149,882,079.18	5.74
7	其他各项资产	140,338,678.75	5.38
8	合计	2,610,951,924.23	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,820,743.38	1.38
C	制造业	533,314,896.00	20.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,564,116.54	1.64
E	建筑业	86,281,528.99	3.32
F	批发和零售业	17,299,492.50	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	22,345,107.81	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,969,033.85	1.81
J	金融业	1,036,570,209.75	39.85
K	房地产业	118,555,014.06	4.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,939,720,142.88	74.56

### 7.2.2 期末积极投资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	2,990,690.34	0.11
B	采掘业	13,069,847.69	0.50
C	制造业	258,884,897.30	9.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,078,443.00	0.31
E	建筑业	10,084,721.64	0.39
F	批发和零售业	20,676,712.61	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	8,244,757.65	0.32
H	住宿和餐饮业	451,315.20	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,203,243.37	0.85
J	金融业	16,803,392.00	0.65
K	房地产业	4,551,335.16	0.17
L	租赁和商务服务业	6,854,348.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,055,908.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,435,832.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,625,579.46	0.06
S	综合	-	-
	合计	381,011,023.42	14.65

### 7.2.3 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	2,888,619	143,304,388.59	5.51
2	600036	招商银行	5,256,053	125,672,227.23	4.83
3	601166	兴业银行	4,407,848	74,316,317.28	2.86
4	600016	民生银行	8,551,000	70,289,220.00	2.70
5	600000	浦发银行	5,154,049	65,198,719.85	2.51
6	600519	贵州茅台	129,207	60,966,322.95	2.34
7	000002	万 科 A	2,366,500	59,091,505.00	2.27
8	000651	格力电器	1,405,800	57,876,786.00	2.22
9	600030	中信证券	2,764,061	47,044,318.22	1.81
10	601288	农业银行	12,068,800	42,482,176.00	1.63
11	000333	美的集团	935,462	40,262,284.48	1.55
12	601398	工商银行	7,482,300	39,282,075.00	1.51
13	601328	交通银行	6,202,643	38,208,280.88	1.47
14	601668	中国建筑	3,899,000	37,742,320.00	1.45
15	600104	上汽集团	1,129,759	35,079,016.95	1.35
16	600887	伊利股份	1,593,963	34,413,661.17	1.32
17	600837	海通证券	2,309,288	34,292,926.80	1.32
18	601601	中国太保	997,300	33,778,551.00	1.30
19	000858	五 粮 液	580,715	32,322,596.90	1.24
20	002450	康得新	1,388,299	31,264,493.48	1.20
21	601169	北京银行	3,394,669	31,129,114.73	1.20
22	600015	华夏银行	3,237,826	29,852,755.72	1.15
23	002415	海康威视	920,545	29,733,603.50	1.14
24	000725	京东方 A	7,101,800	29,543,488.00	1.14
25	601766	中国中车	2,561,220	25,919,546.40	1.00
26	600048	保利地产	2,541,614	25,339,891.58	0.97
27	601988	中国银行	6,609,400	24,454,780.00	0.94
28	601818	光大银行	5,751,200	23,292,360.00	0.90
29	000001	平安银行	2,325,500	21,836,445.00	0.84
30	600900	长江电力	1,385,583	21,310,266.54	0.82
31	600028	中国石化	3,371,016	19,990,124.88	0.77
32	001979	招商蛇口	928,518	19,833,144.48	0.76

33	000063	中兴通讯	807,770	19,176,459.80	0.74
34	600518	康美药业	852,100	18,524,654.00	0.71
35	601688	华泰证券	1,014,352	18,156,900.80	0.70
36	601989	中国重工	2,797,697	17,373,698.37	0.67
37	601336	新华保险	336,498	17,295,997.20	0.66
38	601009	南京银行	1,430,856	16,039,895.76	0.62
39	600383	金地集团	1,245,900	14,290,473.00	0.55
40	601006	大秦铁路	1,695,579	14,225,907.81	0.55
41	000776	广发证券	816,086	14,077,483.50	0.54
42	601390	中国中铁	1,556,321	13,493,303.07	0.52
43	600999	招商证券	755,500	13,009,710.00	0.50
44	600585	海螺水泥	536,499	12,194,622.27	0.47
45	601901	方正证券	1,208,700	12,002,391.00	0.46
46	601628	中国人寿	437,200	11,795,656.00	0.45
47	000783	长江证券	1,238,181	11,725,574.07	0.45
48	600068	葛洲坝	1,027,500	11,549,100.00	0.44
49	600795	国电电力	3,159,500	11,374,200.00	0.44
50	002230	科大讯飞	279,000	11,132,100.00	0.43
51	600637	东方明珠	513,705	11,131,987.35	0.43
52	002024	苏宁云商	975,998	10,979,977.50	0.42
53	601377	兴业证券	1,446,900	10,750,467.00	0.41
54	601899	紫金矿业	3,095,050	10,616,021.50	0.41
55	600958	东方证券	760,404	10,577,219.64	0.41
56	000166	申万宏源	1,804,967	10,107,815.20	0.39
57	002456	欧菲光	546,045	9,921,637.65	0.38
58	601985	中国核电	1,265,000	9,879,650.00	0.38
59	601186	中国铁建	789,252	9,494,701.56	0.36
60	601600	中国铝业	2,079,200	9,397,984.00	0.36
61	601211	国泰君安	457,300	9,379,223.00	0.36
62	002594	比亚迪	184,442	9,212,877.90	0.35
63	002466	天齐锂业	162,100	8,810,135.00	0.34
64	000625	长安汽车	609,400	8,787,548.00	0.34
65	000728	国元证券	713,088	8,713,935.36	0.33
66	002202	金风科技	532,500	8,237,775.00	0.32
67	000100	TCL 集团	2,394,923	8,214,585.89	0.32
68	600115	东方航空	1,194,000	8,119,200.00	0.31
69	601669	中国电建	943,633	7,473,573.36	0.29
70	600705	中航资本	1,286,200	7,267,030.00	0.28
71	601099	太平洋	1,784,778	7,174,807.56	0.28

72	000839	中信国安	716,300	7,155,837.00	0.28
73	600109	国金证券	610,538	7,155,505.36	0.28
74	000413	东旭光电	615,500	6,905,910.00	0.27
75	601555	东吴证券	599,000	6,726,770.00	0.26
76	600804	鹏博士	377,098	6,693,489.50	0.26
77	601618	中国中冶	1,303,100	6,528,531.00	0.25
78	000768	中航飞机	353,400	6,516,696.00	0.25
79	600100	同方股份	454,557	6,418,344.84	0.25
80	600739	辽宁成大	350,500	6,319,515.00	0.24
81	600111	北方稀土	550,765	6,240,167.45	0.24
82	600570	恒生电子	132,900	6,203,772.00	0.24
83	600489	中金黄金	519,900	5,214,597.00	0.20
84	000503	海虹控股	183,600	4,577,148.00	0.18
85	002673	西部证券	12,600	179,172.00	0.01
86	600050	中国联通	10,000	74,700.00	0.00

### 7.3.2 期末积极投资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	600559	老白干酒	2,900,000	82,476,000.00	3.17
2	002236	大华股份	630,400	14,379,424.00	0.55
3	600031	三一重工	1,533,500	12,467,355.00	0.48
4	002142	宁波银行	516,400	9,966,520.00	0.38
5	000039	中集集团	450,727	8,126,607.81	0.31
6	600703	三安光电	383,036	7,545,809.20	0.29
7	600643	爱建集团	456,400	6,836,872.00	0.26
8	600114	东睦股份	287,400	5,029,500.00	0.19
9	300025	华星创业	598,500	4,710,195.00	0.18
10	300156	神雾环保	141,792	4,645,105.92	0.18
11	000661	长春高新	33,619	4,340,549.09	0.17
12	600535	天士力	104,027	4,321,281.58	0.17
13	600309	万华化学	146,500	4,195,760.00	0.16
14	600885	宏发股份	104,322	4,161,404.58	0.16
15	000568	泸州老窖	80,100	4,051,458.00	0.16
16	600153	建发股份	304,900	3,942,357.00	0.15
17	600038	中直股份	86,072	3,939,515.44	0.15
18	300197	铁汉生态	285,310	3,788,916.80	0.15

19	600079	人福医药	186,000	3,649,320.00	0.14
20	600116	三峡水利	316,500	3,547,965.00	0.14
21	002127	南极电商	286,600	3,462,128.00	0.13
22	600233	圆通速递	173,935	3,407,386.65	0.13
23	002195	二三四五	474,624	3,393,561.60	0.13
24	002640	跨境通	151,900	3,227,875.00	0.12
25	002368	太极股份	112,199	3,106,790.31	0.12
26	000968	*ST 煤气	214,400	3,100,224.00	0.12
27	600089	特变电工	292,837	3,025,006.21	0.12
28	000998	隆平高科	135,817	2,990,690.34	0.11
29	300014	亿纬锂能	164,300	2,982,045.00	0.11
30	600750	江中药业	83,783	2,911,459.25	0.11
31	002737	葵花药业	93,666	2,884,912.80	0.11
32	300335	迪森股份	150,400	2,883,168.00	0.11
33	002138	顺络电子	154,385	2,868,473.30	0.11
34	000826	启迪桑德	79,200	2,781,504.00	0.11
35	300036	超图软件	169,000	2,763,150.00	0.11
36	002035	华帝股份	109,376	2,646,899.20	0.10
37	002589	瑞康医药	168,240	2,590,896.00	0.10
38	601633	长城汽车	188,100	2,499,849.00	0.10
39	600019	宝钢股份	372,500	2,499,475.00	0.10
40	300124	汇川技术	97,803	2,497,888.62	0.10
41	002120	韵达股份	48,000	2,476,800.00	0.10
42	603377	东方时尚	64,800	2,435,832.00	0.09
43	600998	九州通	112,500	2,425,500.00	0.09
44	300319	麦捷科技	272,394	2,377,999.62	0.09
45	002663	普邦园林	436,900	2,372,367.00	0.09
46	600801	华新水泥	248,000	2,363,440.00	0.09
47	600270	外运发展	124,700	2,360,571.00	0.09
48	601933	永辉超市	332,000	2,350,560.00	0.09
49	002074	国轩高科	71,154	2,244,908.70	0.09
50	600329	中新药业	120,900	2,189,499.00	0.08
51	002050	三花智控	133,300	2,175,456.00	0.08
52	300424	航新科技	44,500	2,099,065.00	0.08
53	601857	中国石油	271,538	2,088,127.22	0.08
54	300308	中际装备	50,700	2,085,291.00	0.08
55	000065	北方国际	86,928	2,067,147.84	0.08
56	002462	嘉事堂	51,311	2,016,009.19	0.08
57	300550	和仁科技	49,166	2,006,464.46	0.08

58	002271	东方雨虹	53,600	1,988,560.00	0.08
59	002174	游族网络	62,400	1,981,824.00	0.08
60	600594	益佰制药	129,808	1,980,870.08	0.08
61	002146	荣盛发展	197,700	1,951,299.00	0.08
62	600201	生物股份	54,471	1,937,533.47	0.07
63	600176	中国巨石	175,800	1,930,284.00	0.07
64	600340	华夏幸福	57,064	1,916,209.12	0.07
65	002831	裕同科技	25,400	1,905,000.00	0.07
66	600612	老凤祥	38,348	1,877,901.56	0.07
67	600298	安琪酵母	72,300	1,870,401.00	0.07
68	600491	龙元建设	173,000	1,856,290.00	0.07
69	002597	金禾实业	84,500	1,847,170.00	0.07
70	603737	三棵树	26,401	1,693,096.13	0.07
71	600872	中炬高新	92,300	1,689,090.00	0.06
72	002027	分众传媒	120,200	1,653,952.00	0.06
73	300332	天壕环境	163,100	1,647,310.00	0.06
74	300210	森远股份	169,261	1,641,831.70	0.06
75	300170	汉得信息	152,500	1,572,275.00	0.06
76	600977	中国电影	82,644	1,547,095.68	0.06
77	300021	大禹节水	181,750	1,492,167.50	0.06
78	002572	索菲亚	36,200	1,484,200.00	0.06
79	600690	青岛海尔	97,300	1,464,365.00	0.06
80	601636	旗滨集团	320,800	1,446,808.00	0.06
81	002091	江苏国泰	147,030	1,404,136.50	0.05
82	000921	海信科龙	81,300	1,399,173.00	0.05
83	300078	思创医惠	130,190	1,396,938.70	0.05
84	300310	宜通世纪	105,500	1,394,710.00	0.05
85	600583	海油工程	213,968	1,335,160.32	0.05
86	600366	宁波韵升	75,281	1,327,956.84	0.05
87	600522	中天科技	109,500	1,319,475.00	0.05
88	002385	大北农	208,700	1,312,723.00	0.05
89	000933	*ST 神火	177,400	1,293,246.00	0.05
90	603993	洛阳钼业	251,931	1,274,770.86	0.05
91	300188	美亚柏科	73,700	1,274,273.00	0.05
92	000630	铜陵有色	446,574	1,268,270.16	0.05
93	601088	中国神华	53,700	1,260,876.00	0.05
94	600335	国机汽车	103,578	1,238,792.88	0.05
95	600282	南钢股份	317,100	1,176,441.00	0.05
96	600188	兖州煤业	95,900	1,173,816.00	0.05

97	000970	中科三环	79,200	1,170,576.00	0.04
98	603816	顾家家居	18,800	1,105,064.00	0.04
99	002281	光迅科技	48,714	1,082,425.08	0.04
100	000501	鄂武商 A	57,208	1,056,059.68	0.04
101	600963	岳阳林纸	137,600	1,036,128.00	0.04
102	601225	陕西煤业	137,900	974,953.00	0.04
103	601012	隆基股份	56,400	964,440.00	0.04
104	600809	山西汾酒	27,800	964,382.00	0.04
105	002311	海大集团	52,000	950,040.00	0.04
106	603898	好莱客	25,700	898,215.00	0.03
107	002080	中材科技	41,600	824,512.00	0.03
108	600779	水井坊	32,700	803,766.00	0.03
109	603808	歌力思	26,300	776,376.00	0.03
110	002567	唐人神	73,987	764,285.71	0.03
111	002188	巴士在线	28,400	729,880.00	0.03
112	002042	华孚色纺	67,200	718,368.00	0.03
113	000603	盛达矿业	50,422	684,730.76	0.03
114	600708	DR 光明地	102,986	683,827.04	0.03
115	603877	太平鸟	23,400	654,966.00	0.03
116	600392	盛和资源	48,600	641,034.00	0.02
117	002648	卫星石化	38,200	630,300.00	0.02
118	600549	XD 厦门钨	28,900	621,061.00	0.02
119	601888	中国国旅	20,600	620,884.00	0.02
120	600259	广晟有色	15,500	605,120.00	0.02
121	603818	曲美家居	35,303	562,376.79	0.02
122	000709	河钢股份	128,700	539,253.00	0.02
123	000898	鞍钢股份	87,000	492,420.00	0.02
124	002087	新野纺织	80,000	452,000.00	0.02
125	600258	首旅酒店	19,320	451,315.20	0.02
126	600595	中孚实业	93,408	450,226.56	0.02
127	002419	天虹商场	29,522	424,526.36	0.02
128	600054	黄山旅游	23,200	396,720.00	0.02
129	600138	中青旅	18,400	387,504.00	0.01
130	600507	方大特钢	43,200	368,496.00	0.01
131	002159	三特索道	15,200	364,800.00	0.01
132	600808	马钢股份	89,700	317,538.00	0.01
133	000778	新兴铸管	47,000	314,900.00	0.01
134	601699	潞安环能	38,807	303,470.74	0.01
135	000888	峨眉山 A	21,500	273,050.00	0.01

136	000983	西山煤电	30,627	268,598.79	0.01
137	000978	桂林旅游	25,900	239,834.00	0.01
138	000761	本钢板材	43,600	228,028.00	0.01
139	002343	慈文传媒	2,073	78,483.78	0.00
140	601727	上海电气	10,000	75,700.00	0.00
141	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
142	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	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	601166	兴业银行	71,221,397.79	2.93
2	000002	万科A	54,915,724.84	2.26
3	601328	交通银行	46,439,092.43	1.91
4	600030	中信证券	44,656,966.62	1.83
5	000651	格力电器	44,468,752.43	1.83
6	601288	农业银行	39,858,159.00	1.64
7	601668	中国建筑	38,812,981.62	1.59
8	600015	华夏银行	36,545,631.40	1.50
9	601398	工商银行	36,055,598.00	1.48
10	601169	北京银行	32,621,755.42	1.34
11	601601	中国太保	30,298,837.78	1.24
12	600104	上汽集团	30,159,305.62	1.24
13	601766	中国中车	27,580,905.88	1.13
14	002450	康得新	26,907,785.29	1.11
15	000725	京东方A	25,818,905.00	1.06
16	000858	五粮液	25,204,565.39	1.04
17	600048	保利地产	24,702,525.99	1.01
18	601988	中国银行	23,980,077.00	0.99
19	601818	光大银行	23,377,768.00	0.96
20	601009	南京银行	21,271,951.89	0.87

注：1、“买入金额”按成交金额（成交单价乘以数量）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	600276	恒瑞医药	214,282,814.97	8.80
2	000895	双汇发展	131,494,141.40	5.40
3	000333	美的集团	125,694,719.88	5.16
4	600887	伊利股份	84,276,778.32	3.46
5	601800	中国交建	79,543,933.78	3.27
6	001979	招商蛇口	74,233,073.76	3.05
7	601186	中国铁建	65,923,923.74	2.71
8	600118	中国卫星	64,513,412.38	2.65
9	000776	广发证券	60,647,165.66	2.49
10	601989	中国重工	60,291,649.32	2.48
11	601669	中国电建	59,242,411.35	2.43
12	600535	天士力	54,313,835.08	2.23
13	601390	中国中铁	52,769,821.15	2.17
14	002415	海康威视	45,684,032.75	1.88
15	601688	华泰证券	45,563,083.60	1.87
16	000100	TCL 集团	43,393,010.72	1.78
17	600837	海通证券	24,734,399.91	1.02
18	600000	浦发银行	20,024,682.57	0.82
19	600519	贵州茅台	16,594,001.60	0.68
20	601318	中国平安	16,027,255.17	0.66

注：1、“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,806,708,524.17
卖出股票收入（成交）总额	1,627,924,000.94

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投资。

**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投资。



**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投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券包括中信证券（证券代码：600030）。**

根据中信证券股份有限公司于 2017 年 5 月 24 日发布的公告，该上市公司收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），中信证券在融资融券业务开展过程中，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31 号）第十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年……证券公司不得向其融资、融券”的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

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

**7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。****7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	204,235.50
2	应收证券清算款	140,083,982.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-4,400.19
5	应收申购款	54,627.65
6	其他应收款	233.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,338,678.75

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	600559	老白干酒	82,476,000.00	3.17	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
180,253	13,238.83	4,935,010.18	0.21%	2,381,403,460.69	99.79%

### 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	13,816.04	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 8 月 11 日）基金份额总额	1,085,604,444.01
本报告期期初基金份额总额	2,532,028,272.82
本报告期基金总申购份额	32,396,137.79
减:本报告期基金总赎回份额	178,085,939.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,386,338,470.87

注：总申购份额含转换入份额，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

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	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	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	
东方证券股 份有限公司	3	882,195,737.92	25.69%	821,587.10	26.51%	-
天风证券股 份有限公司	4	815,594,177.04	23.75%	759,563.36	24.51%	新增 4 个 交易单元
东吴证券股 份有限公司	3	467,029,013.41	13.60%	341,536.55	11.02%	-
中国国际金 融有限公司	2	349,977,183.68	10.19%	325,931.50	10.52%	-
第一创业证 券股份有限 公司	2	309,984,854.58	9.03%	288,690.33	9.31%	-
招商证券股 份有限公司	2	148,182,199.69	4.31%	138,002.64	4.45%	-
广发证券股 份有限公司	2	145,506,851.65	4.24%	135,510.45	4.37%	-
华融证券股 份有限公司	1	90,336,535.13	2.63%	84,130.72	2.71%	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	68,785,309.37	2.00%	64,059.77	2.07%	-
东北证券股 份有限公司	4	65,198,284.17	1.90%	60,719.36	1.96%	-
长江证券股 份有限公司	2	63,470,135.65	1.85%	59,109.98	1.91%	-
华泰证券股 份有限公司	5	15,713,899.67	0.46%	11,491.54	0.37%	-
方正证券股 份有限公司	5	12,324,462.22	0.36%	9,013.04	0.29%	-
海通证券股 份有限公司	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	2	-	-	-	-	-

限责任公司						
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	2	-	-	-	-	-
南京证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
民生证券股 份有限公司	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	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
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、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	1,545,000,000.00	33.81%	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	170,000,000.00	3.72%	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	2,080,000,000.00	45.51%	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	440,000,000.00	9.63%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股	-	-	335,000,000.00	7.33%	-	-

份有限公司						
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
宏信证券有 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	-	-	-	-	-	-
光大证券股 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	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券（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	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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经理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 1 月 21 日
3	《关于旗下部分基金持有的宝钢股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 11 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的老白干酒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 22 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 23 日
6	《银华基金关于增加上海华信证券为旗下部分基金代销机构公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 24 日
7	《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经理人网站	2017 年 2 月 27 日
8	《关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 28 日
9	《关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2017 年 2 月 28 日

10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 9 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华-道琼斯 88 精选证券投资基金增聘基金经理的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 17 日
12	《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
13	《银华基金管理股份有限公司关于银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金经理离任的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 18 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 21 日
15	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金更新招募书摘要（2017 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
16	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金更新招募书（2017 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
17	《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
18	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2016 年年度报告》	本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
19	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
20	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
21	《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
22	《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
23	《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

24	《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
25	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的唐人神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 6 月 23 日
26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的中国神华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 6 月 29 日
27	《银华基金管理股份有限公司关于使用建设银行卡网上直销优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华-道琼斯 88 精选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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 29 日