

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 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 28 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 2018 年 8 月 24 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 2018 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.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	39
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.....	40
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.....	49
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.....	49
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.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
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.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62

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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	银华大数据灵活配置定期开放混合发起式
基金主代码	002269
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 7 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	60,878,134.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金使用大数据分析技术，从大量多样化的证券相关数据中，挖掘出有价值的信息以用于投资决策，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金使用大数据分析技术，从大量多样化的证券相关数据中，挖掘出有价值的信息用于资产配置和股票选择，力争实现基金资产的长期稳健增值。 基金的投资组合比例为：在开放期内股票投资比例为基金资产的 0%-95%，在封闭期内股票投资比例为基金资产的 0%-100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；开放期内的每个交易日日终，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。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。
业绩比较基准	年化收益率 5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

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	陈四清

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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,656,718.99
本期利润	-7,164,147.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1060
本期加权平均净值利润率	-11.63%
本期基金份额净值增长率	-11.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-10,478,533.22
期末可供分配基金份额利润	-0.1721
期末基金资产净值	50,399,601.42
期末基金份额净值	0.828
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.20%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中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。

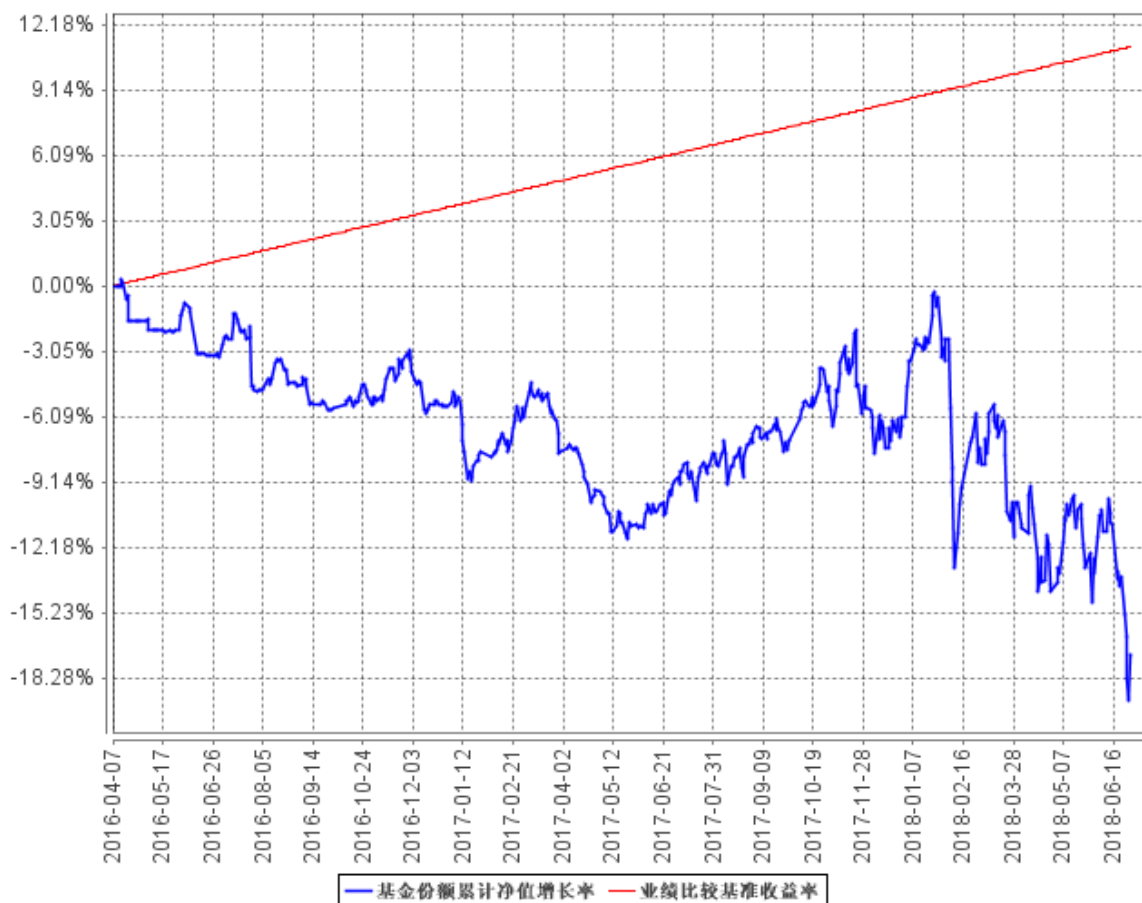
3.2 基金净值表现

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	-5.15%	1.38%	0.37%	0.01%	-5.52%	1.37%
过去三个月	-7.90%	1.22%	1.13%	0.01%	-9.03%	1.21%
过去六个月	-11.82%	1.24%	2.28%	0.01%	-14.10%	1.23%
过去一年	-8.91%	0.98%	4.71%	0.01%	-13.62%	0.97%
自基金合同生效起至今	-17.20%	0.72%	11.16%	0.01%	-28.36%	0.71%

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：在开放期内股票投资比例为基金资产的 0%–95%，在封闭期内股票投资比例为基金资产的 0%–100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%–3%；开放期内的每个交易日日终，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。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

§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 2.222 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 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业股份有限公司 0.90%，杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 100 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、银华永祥灵活配置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、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金。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		
张凯先生	本基金的基金经理	2016年4月7日	-	8年	硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自2012年11月14日起担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2013年11月5日起兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2016年4月25日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日起兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017年10月12日	-	5.5年	硕士学位，曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司，2015年加入银华基金，历任量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效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、《银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券

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

在报告期内,我们积极改进自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。除此之外运用自行开发的量化投资模型,精选细分子行业个股,力争实现超越行业的阿尔法收益。

2018 年上半年 A 股市场震荡下跌,先是延续去年下半年上涨行情持续一段时间,继而震荡下跌,尤其是 6 月受中美贸易战和地产棚改降温的负面影响,市场出现大幅度普跌调整。从风格方面,价值蓝筹和新兴成长轮动幅度较大,反映出市场情绪的极不稳定。行业方面,仍然是代表消费升级趋势的食品饮料和餐饮旅游等板块表现强势。

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 0.828 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.82%，业绩比较基准收益率为 2.28%。

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 2018 年下半年，预计宏观经济将平稳运行。国内经济韧性在二季度已逐步得到验证，名义与实际的分化开始弥合，4 月开始库存去化加速加快，A 股盈利增速温和放缓。从数据上看，本轮复苏中国领先，PMI 指标欧洲和日本有所回落，美国与中国向上，OECD 领先指标看欧元区有所下降，北美和亚洲向上。从国内经济基本面看，地产推动下周期行业整体并未出现明显下滑，地产销售新开工持续改善，产业链有望持续向上，政策风险将是制约地产行业的最大风险，上游煤炭、钢铁、水泥行业价格向上、库存向下，石化行业价格高位波动，库存低位震荡，景气度有望维持。中游重卡和工程机械行业销量维持高速增长。而加杠杆导致的可支配收入增速的下降可能会对消费造成了一定的压力，但目前看食品饮料等价格仍保持平稳或者向上的态势，家电等也量价平稳，新能源车产销两旺。政策面上，贸易战压力下，补短板、创新药等方向仍会有催化剂。板块方面，周期股已经对还未恶化的数据做出了提前反映，消费股持仓集中度仍然较高也蕴藏着消费数据增速放缓的风险，相对收益方向上整体更看好超跌的金融和周期板块，创新类板块更看好新能源车、计算机和医药，消费品类依旧是食品饮料最适合避险。

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

本基金本报告期内依据基金合同约定和基金运作情况，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”）在银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”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：银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,838,242.13	5,320.08
结算备付金		220,811.13	3,380,471.87
存出保证金		18,190.16	49,633.91
交易性金融资产	6.4.7.2	45,582,487.83	67,130,280.56
其中：股票投资		45,582,487.83	67,130,280.56
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,030.53	851.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		50,660,761.78	70,566,558.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		-	18.90
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		43,599.00	59,249.92
应付托管费		10,899.74	14,812.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	134,757.56	220,341.87
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	71,904.06	145,000.00
负债合计		261,160.36	439,423.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,878,134.64	74,684,497.02
未分配利润	6.4.7.10	-10,478,533.22	-4,557,361.91
所有者权益合计		50,399,601.42	70,127,135.11
负债和所有者权益总计		50,660,761.78	70,566,558.28

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，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份额净值 0.828 元，基金份额总额 60,878,134.64 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-6,206,719.76	-1,513,715.16
1.利息收入		14,664.05	602,881.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,664.05	75,323.14
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		-	502,769.10
其他利息收入		-	24,789.28
2.投资收益（损失以“-”填列）		-716,723.77	-3,139,271.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,329,153.10	-3,354,745.98
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	-	-53,020.00
股利收益	6.4.7.16	612,429.33	268,494.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,507,428.22	1,009,967.38
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	2,768.18	12,707.08
减：二、费用		957,427.45	2,576,535.33

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	305,031.12	474,129.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	76,257.81	118,532.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	502,716.11	1,900,516.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	73,422.41	83,356.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,164,147.21	-4,090,250.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,164,147.21	-4,090,250.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	74,684,497.02	-4,557,361.91	70,127,135.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,164,147.21	-7,164,147.21
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）	-13,806,362.38	1,242,975.90	-12,563,386.48
其中：1.基金申购款	47,147.56	-1,448.09	45,699.47
2.基金赎回款	-13,853,509.94	1,244,423.99	-12,609,085.95
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）	60,878,134.64	-10,478,533.22	50,399,601.42

项目	上年度可比期间 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)	112,187,432.13	-6,235,189.65	105,952,242.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,090,250.49	-4,090,250.49
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)	-19,078,051.46	1,826,646.17	-17,251,405.29
其中：1.基金申购款	213,615.12	-16,628.91	196,986.21
2.基金赎回款	-19,291,666.58	1,843,275.08	-17,448,391.50
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)	93,109,380.67	-8,498,793.97	84,610,586.70

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 伍军辉
 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

银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金（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]2681号《关于准予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注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2016年3月14日至2016年4月1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_A13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4月7日生效。本基金为契约型开放式，以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。存续期限不定。首次募集的有效净认购金额为人民币144,191,502.69元，折合144,191,502.69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 21,502.83 元，折合 21,502.83 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 144,213,005.52 元，折合 144,213,005.52 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：在开放期内股票投资比例为基金资产的 0%-95%；在封闭期内股票投资比例为基金资产的 0%-100%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；开放期内的每个交易日日终，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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：年化收益率 5%。

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 3 号《半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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,838,242.13
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,838,242.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,580,286.09	45,582,487.83	-4,997,798.26
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	50,580,286.09	45,582,487.83	-4,997,798.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	923.05
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	99.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.08
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.10
合计	1,030.53

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	134,757.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	134,757.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	71,904.06
合计	71,904.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,684,497.02	74,684,497.02
本期申购	47,147.56	47,147.56
本期赎回(以“-”号填列)	-13,853,509.94	-13,853,509.94
- 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	60,878,134.64	60,878,134.64

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，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	-4,965,988.36	408,626.45	-4,557,361.91
本期利润	-1,656,718.99	-5,507,428.22	-7,164,147.21
本期基金份额交易产生的变动数	986,404.07	256,571.83	1,242,975.90
其中：基金申购款	-2,897.43	1,449.34	-1,448.09
基金赎回款	989,301.50	255,122.49	1,244,423.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,636,303.28	-4,842,229.94	-10,478,533.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	12,064.88
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	2,395.84
其他	203.33
合计	14,664.05

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	170,728,394.43
减：卖出股票成本总额	172,057,547.53
买卖股票差价收入	-1,329,153.10

6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	612,429.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	612,429.33

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,507,428.22
——股票投资	-5,507,428.22
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-5,507,428.22

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	2,727.55
转换费收入	40.63
合计	2,768.18

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	502,716.11
银行间市场交易费用	-
合计	502,716.11

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	49,588.57
银行费用	1,518.35
合计	73,422.41

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**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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**

无。

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
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
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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券	32,394,716.82	9.91%	289,753,623.33	22.88%
西南证券	148,486,447.39	45.44%	496,424,129.21	39.19%
第一创业	16,787,964.00	5.14%	115,695,037.40	9.13%

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东北证券	-	-	40,000,000.00	1.16%
西南证券	-	-	2,398,700,000.00	69.85%

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

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 2018年1月1日至2018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	30,169.31	9.96%	20,448.54	15.17%
西南证券	138,286.68	45.64%	28,753.92	21.34%
第一创业	15,634.45	5.16%	8,496.28	6.30%
关联方名称	上年度可比期间 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	269,848.20	22.93%	8,836.52	2.43%
西南证券	462,323.40	39.28%	99,345.48	27.36%
第一创业	107,746.67	9.15%	52,917.22	14.57%

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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	305,031.12	474,129.89
其中：支付销售机构的客户维护费	107,007.12	203,929.40

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,257.81	118,532.48

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 4 月 7 日）持有的基金份额	10,002,600.26	10,002,600.26
期初持有的基金份额	10,002,600.26	10,002,600.26
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,600.26	10,002,600.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.43%	10.74%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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：无。

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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 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	4,838,242.13	12,064.88	597,904.15	41,444.97

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：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2018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：无。

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
000796	凯撒旅游	2018年1月19日	重大事项	12.90	2018年7月19日	11.61	33,200	445,563.01	428,280.00	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	62,356	394,610.70	364,159.04	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	-	-	6,000	111,904.00	90,180.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	18.08	-	-	3,600	65,340.00	65,088.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项	2.02	2018年8月16日	1.83	15,000	33,250.00	30,300.00	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项	10.43	-	-	2,700	27,147.00	28,161.00	-
300118	东方日升	2018年	重大	10.80	2018年	9.63	1,400	16,353.00	15,120.00	-

		5月 7日	事 项		8月 7日					
000825	太钢 不锈	2018 年 4月 16日	重 大 事 项	6.00	-	-	800	4,472.00	4,800.00	-
002573	清新 环境	2018 年 6月 19日	重 大 事 项	11.55	-	-	100	1,587.64	1,155.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。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。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	4,838,242.13	-	-	-	-	-	4,838,242.13
结算备付金	220,811.13	-	-	-	-	-	220,811.13
存出保证金	18,190.16	-	-	-	-	-	18,190.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-45,582,487.83	45,582,487.83
应收利息	-	-	-	-	-	1,030.53	1,030.53
资产总计	5,077,243.42	-	-	-	-	-45,583,518.36	50,660,761.78
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,599.00	43,599.00
应付托管费	-	-	-	-	-	10,899.74	10,899.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	134,757.56	134,757.56
其他负债	-	-	-	-	-	71,904.06	71,904.06
负债总计	-	-	-	-	-	261,160.36	261,160.36
利率敏感度缺口	5,077,243.42	-	-	-	-	-45,322,358.00	50,399,601.42
上年度末 2017 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	5,320.08	-	-	-	-	-	5,320.08
结算备付金	3,380,471.87	-	-	-	-	-	3,380,471.87
存出保证金	49,633.91	-	-	-	-	-	49,633.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-67,130,280.56	67,130,280.56
应收利息	-	-	-	-	-	851.86	851.86
资产总计	3,435,425.86	-	-	-	-	-67,131,132.42	70,566,558.28
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	18.90	18.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,249.92	59,249.92
应付托管费	-	-	-	-	-	14,812.48	14,812.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	220,341.87	220,341.87
其他负债	-	-	-	-	-	145,000.00	145,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	439,423.17	439,423.17
利率敏感度缺口	3,435,425.86	-	-	-	-	-66,691,709.25	70,127,135.11

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率

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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2018年6月30日		上年度末 2017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	45,582,487.83	90.44	67,130,280.56	95.73
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	45,582,487.83	90.44	67,130,280.56	95.73

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）	
		本期末（2018年 6月30日）	上年度末（2017年 12月31日）
分析	+5%	35,957,904.03	12,827,342.79
	-5%	-35,957,904.03	-12,827,342.79

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	45,582,487.83	89.98
	其中：股票	45,582,487.83	89.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,059,053.26	9.99
8	其他各项资产	19,220.69	0.04
9	合计	50,660,761.78	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,272,254.70	4.51
C	制造业	19,433,235.49	38.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	268,312.00	0.53
E	建筑业	561,352.60	1.11
F	批发和零售业	579,796.40	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,938,144.33	3.85
H	住宿和餐饮业	40,656.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服	1,296,078.25	2.57

	务业		
J	金融业	12,401,233.78	24.61
K	房地产业	4,639,353.00	9.21
L	租赁和商务服务业	1,696,853.28	3.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	127,108.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,519.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	292,591.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	45,582,487.83	90.44

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港股通股票投资。

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	601318	中国平安	27,800	1,628,524.00	3.23
2	600048	保利地产	123,600	1,507,920.00	2.99
3	001979	招商蛇口	77,100	1,468,755.00	2.91
4	000333	美的集团	27,500	1,436,050.00	2.85
5	600030	中信证券	84,700	1,403,479.00	2.78
6	000002	万科 A	52,600	1,293,960.00	2.57
7	600519	贵州茅台	1,535	1,122,791.10	2.23
8	600887	伊利股份	37,900	1,057,410.00	2.10
9	600019	宝钢股份	122,600	955,054.00	1.89
10	000651	格力电器	19,100	900,565.00	1.79
11	601288	农业银行	250,800	862,752.00	1.71
12	601398	工商银行	151,600	806,512.00	1.60
13	600276	恒瑞医药	10,200	772,752.00	1.53
14	000001	平安银行	83,400	758,106.00	1.50
15	601166	兴业银行	52,300	753,120.00	1.49
16	002142	宁波银行	46,000	749,340.00	1.49
17	600999	招商证券	52,000	711,360.00	1.41
18	601998	中信银行	113,600	705,456.00	1.40

19	601088	中国神华	34,100	679,954.00	1.35
20	601601	中国太保	21,300	678,405.00	1.35
21	002027	分众传媒	70,800	677,556.00	1.34
22	601336	新华保险	14,400	617,472.00	1.23
23	601225	陕西煤业	72,400	595,128.00	1.18
24	600036	招商银行	22,400	592,256.00	1.18
25	600837	海通证券	62,100	588,087.00	1.17
26	601006	大秦铁路	71,323	585,561.83	1.16
27	600282	南钢股份	124,300	549,406.00	1.09
28	601939	建设银行	81,000	530,550.00	1.05
29	603288	海天味业	7,000	515,480.00	1.02
30	000858	五粮液	6,600	501,600.00	1.00
31	600585	海螺水泥	14,400	482,112.00	0.96
32	002508	老板电器	15,400	471,548.00	0.94
33	002035	华帝股份	18,700	456,841.00	0.91
34	000796	凯撒旅游	33,200	428,280.00	0.85
35	600741	华域汽车	18,000	426,960.00	0.85
36	600309	万华化学	9,200	417,864.00	0.83
37	601899	紫金矿业	114,500	413,345.00	0.82
38	600196	复星医药	9,610	397,757.90	0.79
39	600115	东方航空	56,000	370,720.00	0.74
40	000415	渤海金控	62,356	364,159.04	0.72
41	600029	南方航空	41,450	350,252.50	0.69
42	000786	北新建材	18,300	339,099.00	0.67
43	600104	上汽集团	9,300	325,407.00	0.65
44	002475	立讯精密	14,300	322,322.00	0.64
45	601111	中国国航	36,200	321,818.00	0.64
46	600176	中国巨石	30,680	313,856.40	0.62
47	002415	海康威视	8,400	311,892.00	0.62
48	300408	三环集团	13,000	305,500.00	0.61
49	600426	华鲁恒升	16,400	288,476.00	0.57
50	601233	桐昆股份	16,420	282,752.40	0.56
51	600068	葛洲坝	39,000	281,190.00	0.56
52	601688	华泰证券	18,300	273,951.00	0.54
53	002007	华兰生物	7,700	247,632.00	0.49
54	600089	特变电工	34,003	235,640.79	0.47
55	600050	中国联通	47,500	233,700.00	0.46
56	002311	海大集团	10,900	229,990.00	0.46
57	600588	用友网络	9,100	223,041.00	0.44

58	601888	中国国旅	3,400	218,994.00	0.43
59	300122	智飞生物	4,600	210,404.00	0.42
60	603799	华友钴业	2,000	194,940.00	0.39
61	300136	信维通信	6,200	190,526.00	0.38
62	300251	光线传媒	18,600	189,348.00	0.38
63	600566	济川药业	3,800	183,122.00	0.36
64	300433	蓝思科技	8,700	182,526.00	0.36
65	600755	厦门国贸	24,600	179,334.00	0.36
66	000975	银泰资源	17,600	178,464.00	0.35
67	600660	福耀玻璃	6,900	177,399.00	0.35
68	300003	乐普医疗	4,700	172,396.00	0.34
69	000568	泸州老窖	2,800	170,408.00	0.34
70	601766	中国中车	21,700	167,090.00	0.33
71	601009	南京银行	21,600	166,968.00	0.33
72	600438	通威股份	24,000	165,600.00	0.33
73	600323	瀚蓝环境	10,800	164,376.00	0.33
74	600111	北方稀土	14,400	163,872.00	0.33
75	000425	徐工机械	37,800	160,272.00	0.32
76	600809	山西汾酒	2,500	157,225.00	0.31
77	000963	华东医药	3,250	156,812.50	0.31
78	600486	扬农化工	2,800	156,604.00	0.31
79	002410	广联达	5,600	155,288.00	0.31
80	600362	江西铜业	9,300	147,405.00	0.29
81	600547	山东黄金	6,000	143,520.00	0.28
82	002242	九阳股份	8,100	143,289.00	0.28
83	601211	国泰君安	9,700	142,978.00	0.28
84	000895	双汇发展	5,400	142,614.00	0.28
85	600884	杉杉股份	6,200	137,020.00	0.27
86	002706	良信电器	20,900	136,686.00	0.27
87	601857	中国石油	17,500	134,925.00	0.27
88	600266	北京城建	14,000	131,600.00	0.26
89	600804	鹏博士	10,800	129,600.00	0.26
90	002081	金螳螂	12,300	124,230.00	0.25
91	002624	完美世界	4,000	124,040.00	0.25
92	600106	重庆路桥	39,820	119,460.00	0.24
93	600016	民生银行	16,500	115,500.00	0.23
94	600004	白云机场	8,400	109,956.00	0.22
95	601818	光大银行	29,800	109,068.00	0.22
96	000528	柳工	10,100	108,171.00	0.21

97	600600	青岛啤酒	2,400	105,192.00	0.21
98	600038	中直股份	2,600	103,974.00	0.21
99	300166	东方国信	7,000	103,110.00	0.20
100	002008	大族激光	1,900	101,061.00	0.20
101	000898	鞍钢股份	17,800	99,146.00	0.20
102	600008	首创股份	22,400	94,528.00	0.19
103	002195	二三四五	21,470	91,891.60	0.18
104	002310	东方园林	6,000	90,180.00	0.18
105	600376	首开股份	12,600	88,578.00	0.18
106	603788	宁波高发	3,560	87,718.40	0.17
107	300388	国祯环保	4,500	86,715.00	0.17
108	000776	广发证券	6,400	84,928.00	0.17
109	600919	江苏银行	13,234	84,829.94	0.17
110	300144	宋城演艺	3,508	82,438.00	0.16
111	300258	精锻科技	5,900	81,125.00	0.16
112	600125	铁龙物流	8,500	71,145.00	0.14
113	600801	华新水泥	4,700	70,641.00	0.14
114	002841	视源股份	1,300	69,433.00	0.14
115	600123	兰花科创	9,600	66,912.00	0.13
116	600201	生物股份	3,820	65,283.80	0.13
117	000666	经纬纺机	3,600	65,088.00	0.13
118	600031	三一重工	7,000	62,790.00	0.12
119	601678	滨化股份	10,100	62,418.00	0.12
120	000536	华映科技	22,200	61,050.00	0.12
121	002180	纳思达	2,200	60,412.00	0.12
122	600808	马钢股份	16,100	57,799.00	0.11
123	600702	舍得酒业	1,600	57,744.00	0.11
124	000667	美好置业	27,000	57,510.00	0.11
125	000701	厦门信达	8,000	55,520.00	0.11
126	002724	海洋王	9,840	55,005.60	0.11
127	002572	索菲亚	1,700	54,706.00	0.11
128	300616	尚品宅配	500	54,500.00	0.11
129	002416	爱施德	9,120	53,534.40	0.11
130	300039	上海凯宝	9,200	53,360.00	0.11
131	600382	广东明珠	5,000	52,750.00	0.10
132	300357	我武生物	1,300	51,831.00	0.10
133	002555	三七互娱	4,200	51,030.00	0.10
134	002625	光启技术	3,900	45,669.00	0.09
135	600436	片仔癀	400	44,772.00	0.09

136	002439	启明星辰	2,100	44,562.00	0.09
137	600114	东睦股份	4,500	43,965.00	0.09
138	300124	汇川技术	1,300	42,666.00	0.08
139	600028	中国石化	6,400	41,536.00	0.08
140	300036	超图软件	2,000	40,780.00	0.08
141	600754	锦江股份	1,100	40,656.00	0.08
142	000826	启迪桑德	2,100	36,708.00	0.07
143	600835	上海机电	1,900	35,834.00	0.07
144	300015	爱尔眼科	1,100	35,519.00	0.07
145	601222	林洋能源	7,000	34,860.00	0.07
146	300628	亿联网络	500	32,955.00	0.07
147	300204	舒泰神	3,000	32,460.00	0.06
148	000069	华侨城 A	4,300	31,089.00	0.06
149	600022	山东钢铁	15,000	30,300.00	0.06
150	601668	中国建筑	5,460	29,811.60	0.06
151	600015	华夏银行	4,000	29,800.00	0.06
152	600335	国机汽车	2,700	28,161.00	0.06
153	601636	旗滨集团	6,200	27,590.00	0.05
154	603369	今世缘	1,200	27,396.00	0.05
155	000727	华东科技	14,300	26,884.00	0.05
156	002405	四维图新	1,300	26,325.00	0.05
157	002773	康弘药业	500	26,005.00	0.05
158	600967	内蒙一机	2,000	25,480.00	0.05
159	002371	北方华创	500	24,835.00	0.05
160	000671	阳光城	4,100	24,477.00	0.05
161	300295	三六五网	1,800	23,976.00	0.05
162	600885	宏发股份	780	23,337.60	0.05
163	002460	赣锋锂业	600	23,148.00	0.05
164	600383	金地集团	2,200	22,418.00	0.04
165	300009	安科生物	1,200	22,128.00	0.04
166	002074	国轩高科	1,545	21,722.70	0.04
167	603008	喜临门	1,000	19,780.00	0.04
168	600557	康缘药业	1,600	19,760.00	0.04
169	600867	通化东宝	800	19,176.00	0.04
170	601717	郑煤机	2,900	16,849.00	0.03
171	000423	东阿阿胶	300	16,143.00	0.03
172	002174	游族网络	800	15,920.00	0.03
173	002506	协鑫集成	3,300	15,444.00	0.03
174	600216	浙江医药	1,200	15,324.00	0.03

175	300118	东方日升	1,400	15,120.00	0.03
176	601012	隆基股份	820	13,685.80	0.03
177	002304	洋河股份	100	13,160.00	0.03
178	603416	信捷电气	500	12,965.00	0.03
179	601100	恒立液压	600	12,528.00	0.02
180	002251	步步高	1,100	12,518.00	0.02
181	600516	方大炭素	500	12,190.00	0.02
182	000488	晨鸣纸业	900	11,628.00	0.02
183	600373	中文传媒	900	11,565.00	0.02
184	300310	宜通世纪	1,600	10,208.00	0.02
185	600126	杭钢股份	1,700	10,149.00	0.02
186	002832	比音勒芬	272	10,064.00	0.02
187	600782	新钢股份	1,800	10,044.00	0.02
188	002456	欧菲科技	600	9,678.00	0.02
189	300369	绿盟科技	900	9,630.00	0.02
190	603993	洛阳钼业	1,500	9,435.00	0.02
191	600027	华电国际	2,400	9,408.00	0.02
192	300027	华谊兄弟	1,500	9,240.00	0.02
193	600160	巨化股份	1,250	9,150.00	0.02
194	300274	阳光电源	1,000	8,970.00	0.02
195	603359	东珠景观	400	8,648.00	0.02
196	000830	鲁西化工	500	8,540.00	0.02
197	600859	王府井	400	8,508.00	0.02
198	600655	豫园股份	900	8,505.00	0.02
199	002002	鸿达兴业	1,800	8,298.00	0.02
200	600057	厦门象屿	1,576	7,864.24	0.02
201	600704	物产中大	1,400	7,322.00	0.01
202	000418	小天鹅 A	100	6,935.00	0.01
203	601933	永辉超市	900	6,876.00	0.01
204	600820	隧道股份	1,100	6,501.00	0.01
205	000636	风华高科	400	6,352.00	0.01
206	002599	盛通股份	600	6,258.00	0.01
207	600285	羚锐制药	700	6,237.00	0.01
208	600720	祁连山	900	6,066.00	0.01
209	000703	恒逸石化	400	5,952.00	0.01
210	603258	电魂网络	287	5,725.65	0.01
211	000513	丽珠集团	130	5,713.50	0.01
212	000828	东莞控股	700	5,586.00	0.01
213	600779	水井坊	100	5,523.00	0.01

214	000623	吉林敖东	300	5,394.00	0.01
215	600284	浦东建设	1,100	5,368.00	0.01
216	000937	冀中能源	1,300	5,343.00	0.01
217	600525	长园集团	500	5,285.00	0.01
218	600498	烽火通信	200	4,970.00	0.01
219	002466	天齐锂业	100	4,959.00	0.01
220	000567	海德股份	300	4,947.00	0.01
221	603030	全筑股份	700	4,823.00	0.01
222	000825	太钢不锈	800	4,800.00	0.01
223	603338	浙江鼎力	100	4,640.00	0.01
224	603019	中科曙光	100	4,587.00	0.01
225	600346	恒力股份	300	4,398.00	0.01
226	600393	粤泰股份	1,200	4,344.00	0.01
227	600970	中材国际	600	4,008.00	0.01
228	002202	金风科技	300	3,792.00	0.01
229	600271	航天信息	150	3,790.50	0.01
230	000970	中科三环	400	3,740.00	0.01
231	600350	山东高速	900	3,645.00	0.01
232	600971	恒源煤电	500	3,570.00	0.01
233	002146	荣盛发展	400	3,492.00	0.01
234	300467	迅游科技	100	3,210.00	0.01
235	002318	久立特材	500	3,010.00	0.01
236	601618	中国中冶	900	2,997.00	0.01
237	601566	九牧王	200	2,950.00	0.01
238	300199	翰宇药业	200	2,856.00	0.01
239	000050	深天马 A	200	2,844.00	0.01
240	000902	新洋丰	300	2,760.00	0.01
241	300338	开元股份	200	2,714.00	0.01
242	600511	国药股份	100	2,695.00	0.01
243	000807	云铝股份	500	2,590.00	0.01
244	601186	中国铁建	300	2,586.00	0.01
245	603568	伟明环保	100	2,530.00	0.01
246	603900	莱绅通灵	125	2,517.50	0.00
247	601607	上海医药	100	2,390.00	0.00
248	002261	拓维信息	500	2,300.00	0.00
249	000965	天保基建	500	2,210.00	0.00
250	600748	上实发展	400	2,016.00	0.00
251	600703	三安光电	100	1,922.00	0.00
252	000521	美菱电器	500	1,920.00	0.00

253	300113	顺网科技	100	1,741.00	0.00
254	002392	北京利尔	500	1,700.00	0.00
255	600584	长电科技	100	1,694.00	0.00
256	601628	中国人寿	67	1,508.84	0.00
257	002269	美邦服饰	500	1,450.00	0.00
258	600291	西水股份	100	1,336.00	0.00
259	000039	中集集团	100	1,328.00	0.00
260	600079	人福医药	100	1,322.00	0.00
261	600380	健康元	100	1,186.00	0.00
262	002573	清新环境	100	1,155.00	0.00
263	000040	东旭蓝天	100	1,010.00	0.00
264	601677	明泰铝业	100	1,004.00	0.00
265	601231	环旭电子	100	907.00	0.00
266	600153	建发股份	100	899.00	0.00
267	000338	潍柴动力	100	875.00	0.00
268	600409	三友化工	100	861.00	0.00
269	002203	海亮股份	100	810.00	0.00
270	000829	天音控股	100	733.00	0.00
271	000759	中百集团	100	721.00	0.00
272	600978	宜华生活	100	683.00	0.00
273	600708	光明地产	130	559.00	0.00
274	600308	华泰股份	100	498.00	0.00
275	600657	信达地产	100	425.00	0.00
276	000725	京东方 A	100	354.00	0.00
277	600577	精达股份	100	347.00	0.00
278	600256	广汇能源	30	122.70	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	601318	中国平安	6,494,908.00	9.26
2	600887	伊利股份	3,231,343.00	4.61
3	600019	宝钢股份	3,190,741.00	4.55
4	600276	恒瑞医药	3,012,515.60	4.30
5	000651	格力电器	2,845,330.00	4.06

6	600048	保利地产	2,674,968.00	3.81
7	600519	贵州茅台	2,669,240.55	3.81
8	001979	招商蛇口	2,618,270.00	3.73
9	601888	中国国旅	2,550,234.00	3.64
10	000002	万科 A	2,458,159.00	3.51
11	002027	分众传媒	2,451,762.00	3.50
12	600030	中信证券	2,424,830.00	3.46
13	601088	中国神华	2,281,584.00	3.25
14	601601	中国太保	2,185,652.00	3.12
15	000333	美的集团	2,052,097.00	2.93
16	601398	工商银行	1,987,778.40	2.83
17	601288	农业银行	1,733,947.00	2.47
18	601166	兴业银行	1,702,470.00	2.43
19	601336	新华保险	1,677,129.00	2.39
20	600036	招商银行	1,662,291.00	2.37
21	600585	海螺水泥	1,660,897.00	2.37
22	600104	上汽集团	1,596,554.55	2.28
23	000858	五粮液	1,467,368.52	2.09
24	600383	金地集团	1,427,940.00	2.04

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	5,011,829.00	7.15
2	600276	恒瑞医药	3,162,578.00	4.51
3	000651	格力电器	2,934,789.00	4.18
4	601888	中国国旅	2,791,702.00	3.98
5	600887	伊利股份	2,269,523.00	3.24
6	600104	上汽集团	2,254,769.00	3.22
7	002027	分众传媒	2,146,006.00	3.06
8	600519	贵州茅台	2,130,788.00	3.04
9	600019	宝钢股份	2,065,361.52	2.95
10	600690	青岛海尔	2,011,409.00	2.87
11	601398	工商银行	1,876,485.00	2.68
12	601166	兴业银行	1,755,056.00	2.50

13	000858	五粮液	1,696,745.00	2.42
14	601288	农业银行	1,633,075.00	2.33
15	600036	招商银行	1,619,117.00	2.31
16	601088	中国神华	1,524,493.70	2.17
17	002415	海康威视	1,522,385.00	2.17
18	601939	建设银行	1,519,038.00	2.17
19	600028	中国石化	1,518,243.00	2.16
20	002008	大族激光	1,504,582.61	2.15
21	600585	海螺水泥	1,498,177.00	2.14
22	601601	中国太保	1,445,762.00	2.06
23	000333	美的集团	1,432,402.00	2.04
24	000002	万科 A	1,407,180.00	2.01

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	156,017,183.02
卖出股票收入（成交）总额	170,728,394.43

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：本基金报告期末未持有资产支证券。

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	18,190.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,030.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,220.69

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，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
1,025	59,393.30	10,002,600.26	16.43%	50,875,534.38	83.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,014.08	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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,600.26	16.43	10,002,600.26	16.43	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,600.26	16.43	10,002,600.26	16.43	3 年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,002,600.26 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 2,600.26 份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年4月7日）基金份额总额	144,213,005.52
本报告期期初基金份额总额	74,684,497.02
本报告期基金总申购份额	47,147.56
减：本报告期基金总赎回份额	13,853,509.94
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	60,878,134.64

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

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

本基金管理人于 2018 年 6 月 23 日发布关于副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，苏薪茗先生自 2018 年 6 月 21 日起担任本基金管理人副总经理职务。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
西南证券股份 有限公司	3	148,486,447.39	45.44%	138,286.68	45.64%	—
东北证券股份 有限公司	2	32,394,716.82	9.91%	30,169.31	9.96%	—
中信建投证 券股份有限 公司	3	31,967,214.28	9.78%	29,771.49	9.83%	—
国金证券股 份有限公司	1	19,961,586.06	6.11%	18,590.14	6.14%	—
西部证券股 份有限公司	1	19,777,099.70	6.05%	18,418.46	6.08%	—
渤海证券股 份有限公司	3	17,673,472.46	5.41%	16,459.18	5.43%	—
第一创业证 券股份有限 公司	1	16,787,964.00	5.14%	15,634.45	5.16%	—
兴业证券股 份有限公司	1	11,224,577.00	3.44%	10,453.52	3.45%	—
招商证券股 份有限公司	2	10,842,014.54	3.32%	10,096.94	3.33%	—
中信证券股 份有限公司	3	7,818,780.85	2.39%	7,281.49	2.40%	—
新时代证券 股份有限公 司	2	6,465,215.80	1.98%	4,728.14	1.56%	—
山西证券股 份有限公司	1	3,342,587.05	1.02%	3,112.91	1.03%	—
国元证券股 份有限公司	1	—	—	—	—	—
国开证券有 限责任公司	1	—	—	—	—	—
恒泰证券股 份有限公司	1	—	—	—	—	—
申万宏源集 团股份有限 公司	2	—	—	—	—	—
华创证券有 限责任公司	2	—	—	—	—	—
华融证券股 份有限公司	2	—	—	—	—	—
华泰证券股 份有限公司	2	—	—	—	—	—

华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中天证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

川财证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
财富证券有 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证	-	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国开证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 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	-	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

中天证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司 2017 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	2018 年 1 月 2 日
2	《银华基金管理股份有限公司关于证券投资基金执行增值税政策的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 3 日
3	《关于网上直销开通中国建设银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 3 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金代销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	2018 年 1 月 10 日
5	《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 2017 年第 4 季度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 19 日
6	《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开放及暂停申购、赎回及转换业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 23 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于参加大泰金石基金销售有限公司和北京展恒基金销售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	2018 年 2 月 8 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的万华化学、中粮生化估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 2 月 10 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 9 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分公开募集开放式证券投资基金赎回费的提示性公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 27 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款及调整赎回费的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
12	《银华大数据灵活配置定期开放混合发起式证券投资基金托管协议（2018 年 3 月修订）》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日

13	《银华大数据灵活配置定期开放混合发起式证券投资基金基金合同（2018年3月修订）》	本基金管理人网站	2018年3月28日
14	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加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	2018年3月30日
15	《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》	四大证券报及本基金管理人网站	2018年3月30日
16	《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2017年年度报告摘要》	上海证券报及本基金管理人网站	2018年3月30日
17	《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2017年年度报告》	本基金管理人网站	2018年3月30日
18	《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开放及暂停申购、赎回及转换业务的公告》	上海证券报及本基金管理人网站	2018年4月19日
19	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的中兴通讯估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018年4月20日
20	《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2018年第1季度报告》	上海证券报及本基金管理人网站	2018年4月23日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018年4月24日
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018年4月24日
23	《关于网上直销开通中国农业银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018年5月3日
24	《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更新招募说明书摘要（2018年第1号）》	上海证券报及本基金管理人网站	2018年5月18日
25	《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更新招募说明书（2018年第1号）》	本基金管理人网站	2018年5月18日

26	《银华基金管理股份有限公司关于公司旗下部分基金持有中兴通讯估值调整情况的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 21 日
27	《银华基金管理股份有限公司关于暂停及恢复网上交易相关业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
28	《银华基金管理股份有限公司关于开通超级生利宝赎回转购业务并实施费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
29	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京格上富信基金销售有限公司为旗下部分基金代销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	2018 年 6 月 29 日
30	《银华基金管理股份有限公司关于在中泰证券开通旗下部分基金定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日
31	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加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	2018 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

本基金管理人于 2018 年 3 月 28 日披露了《关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款及调整赎回费的公告》，修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于 2018 年 4 月 1 日起正式实施。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华大数据灵活配置定期开放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 《银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华大数据灵活配置定期开放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

2018年8月28日