

银华互联网主题灵活配置混合型 证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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 2016 年 8 月 22 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 2016 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华互联网主题灵活配置混合
基金主代码	001808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 18 日
基金管理人	银华基金管理有限公司
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	283,472,298.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金深入研究互联网发展带来的投资机会，通过投资受益于互联网改造的传统产业和互联网时代兴起的新兴产业的优质上市公司，在严控风险的前提下，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	根据国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势、行业发展前景的综合分析，形成对各类别资产未来表现的预判，确定不同阶段基金资产在股票、债券以及其他金融工具的配置比例，以最大限度地降低投资组合的风险，提高投资组合的收益。 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%~95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）、股指期货、权证等金融工具，其中投资于本基金界定的互联网主题的上市公司股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过本基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	中证互联网指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

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		银华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010) 58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95566
传真		(010) 58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理有限公司	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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-44,296,464.38
本期利润	-46,648,180.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1538
本期加权平均净值利润率	-18.67%
本期基金份额净值增长率	-13.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-50,879,439.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1795
期末基金资产净值	245,061,864.08
期末基金份额净值	0.865
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.50%

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

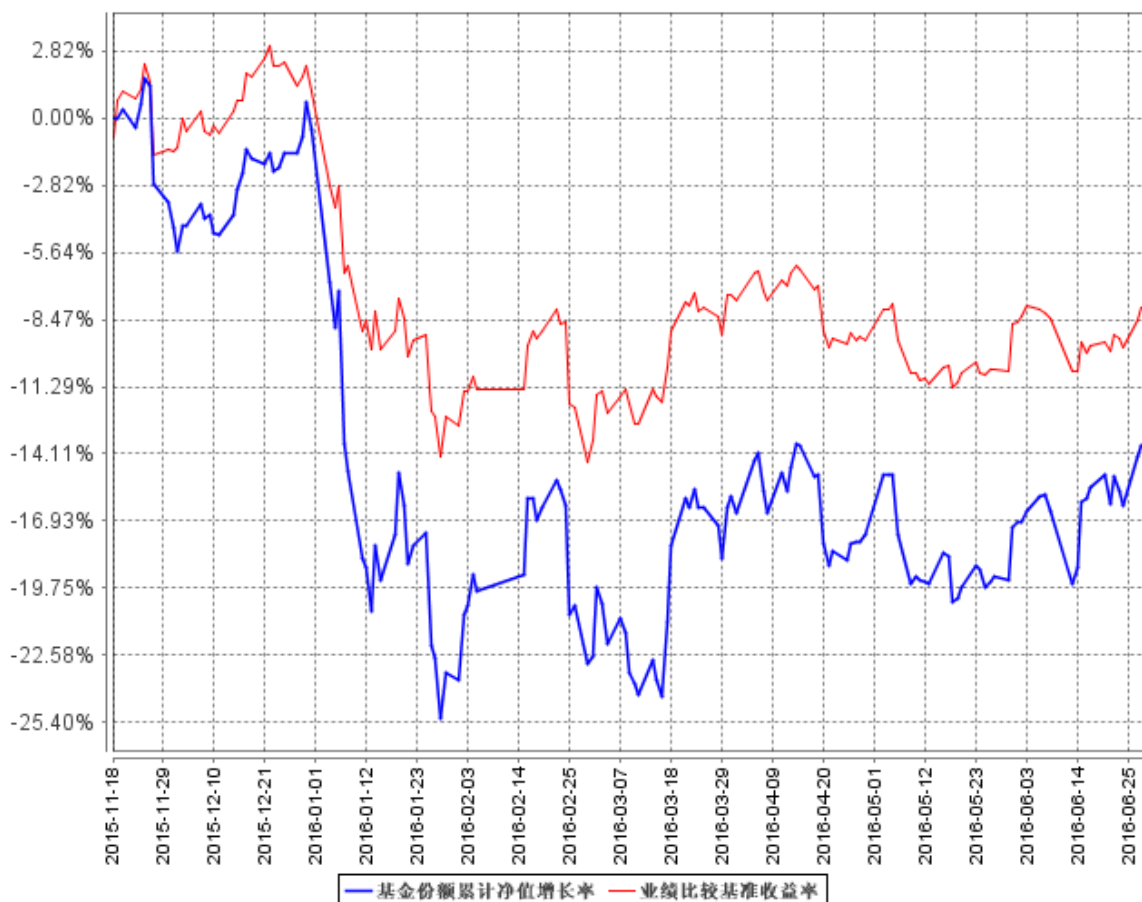
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.47%	1.44%	0.91%	0.79%	3.56%	0.65%
过去三个月	2.85%	1.41%	-0.46%	0.78%	3.31%	0.63%
过去六个月	-13.07%	2.04%	-8.85%	1.19%	-4.22%	0.85%
自基金合同生效起至今	-13.50%	1.87%	-7.83%	1.13%	-5.67%	0.74%

注：本基金业绩比较基准为：中证互联网指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。本基金股票部分主要投资于互联网主题上市公司，中证互联网指数是由中证指数有限公司编制的综合反映互联网主题上市公司整体状况的指数，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。固定收益部分的业绩比较基准则采用能够较好的反映债券市场变动全貌的中证全债指数。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

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：基金的投资组合比例为：股票资产占资金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）、股指期货、权证等金融工具，其中投资于本基金界定的互联网主题的上市公司股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

§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。

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人管理着 62 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和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、银华中证国防安全指数分级证券投资基金、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王浩	本基金基金经理	2015年11月18日	-	7年	硕士学位。2009年1月至今任职于银华基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、研究员、专户投资经理助理。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、《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的 A 股市场主要分为 2 个阶段，1-2 月由于突发的人民币贬值和高企的通胀压力，市场对经济前景极度悲观，认为中国将陷入资金快速外流的失控局面，市场用暴跌的形式反映了对中国经济的悲观预期。3-6 月份市场基本处于底部震荡局面，市场暴跌后部分股票进入了价值投资区间，更重要的是 1 月份人民币大幅贬值后，预期之中的美联储加息和通胀上行迟迟没有出现，市场围绕着美联储加息进行反复博弈，6 月份则是围绕着英国脱欧的概率及其影响进行了激烈的博弈。

在这个典型的存量博弈型市场，市场没有明显的趋势和主线，一个趋势或者逻辑一旦被市场接受，则迅速会发生逆转，缺乏持续性，本质上也是反映企业和经济的基本面无法支撑趋势性行情。另一方面，则是主题投资非常活跃，各种新旧主题此起彼伏，赚钱效应明显。

本基金成立于 2015 年 4 季度，并在年底建立了中性仓位以保持对基准的跟踪，年初净值也随着市场的暴跌快速下降，到 1 月底，本基金认为市场已经充分释放了风险，逐步提高仓位买入了股价调整到位的优质成长股。2 月份以后，淡化了对指数涨跌的预期，仓位变化不大，更加注重对个股的选择和挖掘。用大部分仓位配置经过调整后估值合理，业绩确定性高的成长股，如电子、计算机、传媒、旅游、医药、白酒、养殖等板块的优质标的，另一方面，也适度的积极参与了交易活跃的主题投资，对新能源汽车产业链、OLED、石墨烯、燃料电池等板块做了积极的研究、发掘和配置。

当前时点上，本基金认为未来一段时间仍是国内外宏观因素的真空期，从外围看，英国脱欧的长期影响暂时无从考量，但短期看造成美元走强，美联储 3 季度加息的概率大幅降低，日元也因为英国脱欧而大幅升值，全球新一轮货币宽松竞赛可能已经展开，流动性宽松的环境有利于推

高资产价格，利好 A 股表现。

从国内角度看，经济数据仍在底部徘徊，但进一步恶化的恐慌逐渐缓解，通胀压力也没有增加，货币政策的腾挪空间加大，不排除央行有进一步降息的动作，南方洪涝灾害消退后，新一轮基建投资又将展开，综合来看，经济基础、货币环境、财政政策都在向着积极的方向发展。

综合来看，A 股市场处于微妙的平衡之中，虽然企业盈利和经济形势并不乐观，但悲观的理由也并不充分，未来一段时间仍将维持活跃的交易局面，虽然指数未必有大的行情，但仍会有活跃的个股出现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金基金份额净值为 0.865 元，本报告期份额净值增长率为-13.07%，同期业绩比较基准收益率为-8.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金仍将维持目前的操作策略，以大部分仓位配置估值合理，有安全边际的优质成长股，另一方面，积极跟踪市场，抓住当前市场的主要矛盾，对热点板块适度参与，谋取收益。

另外，这种微妙的平衡并不稳定，如果出现英国脱欧触发了新的危机事件或者国内经济数据意外下滑，通胀超预期等黑天鹅事件，本基金将及时降低仓位，规避风险。

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，本基金托管人在对银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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的真实、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：银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	51,063,167.20	104,474,620.59

结算备付金		206,732.32	2,694,711.39
存出保证金		441,577.05	131,535.20
交易性金融资产	6.4.7.2	205,206,943.21	243,979,215.62
其中：股票投资		205,206,943.21	243,979,215.62
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	11,663.77	34,409.62
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		256,930,083.55	351,314,492.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		9,797,063.69	10,162,762.46
应付赎回款		1,032,153.23	-
应付管理人报酬		294,751.24	422,411.78
应付托管费		49,125.19	70,401.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	616,903.61	732,717.96
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	78,222.51	-
负债合计		11,868,219.47	11,388,294.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	283,472,298.75	341,798,329.31
未分配利润	6.4.7.10	-38,410,434.67	-1,872,131.07
所有者权益合计		245,061,864.08	339,926,198.24
负债和所有者权益总计		256,930,083.55	351,314,492.42

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.865 元，基金份额总额为 283,472,298.75 份。

6.2 利润表

会计主体：银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-41,215,364.25
1.利息收入		251,993.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	251,993.91
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-39,278,748.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-39,737,862.09
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	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	459,113.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,351,715.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	163,106.21
减：二、费用		5,432,815.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,869,003.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	311,500.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,166,007.18
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	86,304.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-46,648,180.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-46,648,180.00

注：本基金于 2015 年 11 月 18 日成立，因此无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	341,798,329.31	-1,872,131.07	339,926,198.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-46,648,180.00	-46,648,180.00
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)	-58,326,030.56	10,109,876.40	-48,216,154.16
其中：1.基金申购款	8,814,385.71	-1,704,297.11	7,110,088.60
2.基金赎回款	-67,140,416.27	11,814,173.51	-55,326,242.76
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)	283,472,298.75	-38,410,434.67	245,061,864.08

注：本基金于 2015 年 11 月 18 日成立，因此无上年度可比期间。

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

杨清

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

银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人银华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可 2015[1902] 号文注册并公开发行。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 341,798,329.31 份，经安永华明会计师事

务所（特殊普通合伙）北京分所验证。《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 18 日正式生效。有关基金设立等文件已按规定向中国证监会备案。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性融工，包括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（包含中小板股票、创业板股票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（含分离交易的可转换债券）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、银行存款（包括定期存款和协议存款）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）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0% -95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）、股指期货、权证等金融工具，其中投资于本基金界定的互联网主题的上市公司股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证互联网指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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 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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，

同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于交易日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证交易日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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；

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《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。

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
	2016 年 6 月 30 日
活期存款	51,063,167.20
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	51,063,167.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	192,918,551.67	205,206,943.21	12,288,391.54
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	192,918,551.67	205,206,943.21	12,288,391.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	11,398.22
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	83.93
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.79
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	178.83
合计	11,663.77

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	616,903.61
银行间市场应付交易费用	-

合计	616,903.61
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,633.45
预提费用	74,589.06
合计	78,222.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	341,798,329.31	341,798,329.31
本期申购	8,814,385.71	8,814,385.71
本期赎回(以“-”号填列)	-67,140,416.27	-67,140,416.27
- 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	283,472,298.75	283,472,298.75

注：本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中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	-16,512,238.23	14,640,107.16	-1,872,131.07
本期利润	-44,296,464.38	-2,351,715.62	-46,648,180.00
本期基金份额交易产生的变动数	9,929,262.89	180,613.51	10,109,876.40
其中：基金申购款	-1,661,908.36	-42,388.75	-1,704,297.11
基金赎回款	11,591,171.25	223,002.26	11,814,173.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,879,439.72	12,469,005.05	-38,410,434.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	233,209.66
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	15,511.52
其他	3,272.73
合计	251,993.91

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,045,037,421.03
减：卖出股票成本总额	1,084,775,283.12
买卖股票差价收入	-39,737,862.09

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无买卖债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期无买卖衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	459,113.34
基金投资产生的股利收益	-

合计	459,113.34
----	------------

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,351,715.62
——股票投资	-2,351,715.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,351,715.62

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	163,106.21
合计	163,106.21

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,166,007.18
银行间市场交易费用	-
合计	3,166,007.18

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	49,726.04

银行费用	11,715.80
合计	86,304.86

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，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理有限公司	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
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构

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

本基金于 2015 年 11 月 18 日成立，因此无上年度可比期间。

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西南证券	225,286,622.21	10.76%	-	-
第一创业	1,018,566,321.63	48.66%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期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 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西南证券	209,809.52	10.84%	209,809.52	34.01%
第一创业	948,592.15	49.02%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,869,003.18	-
其中：支付销售机构的客户维护费	768,819.27	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	311,500.53	-

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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

注：本基金的管理人本报告期末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于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	51,063,167.20	233,209.66	-	-

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：本基金本报告期末在承销期参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002355	兴民钢圈	2016年5月12日	重大事项	21.09	-	-	531,000	9,510,562.89	11,198,790.00	-
000638	万方发展	2016年1月5日	重大事项	23.66	2016年7月25日	24.75	216,200	6,052,655.00	5,115,292.00	-
300299	富春通信	2016年2月29日	重大事项	31.50	-	-	124,100	3,869,657.85	3,909,150.00	-

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性较小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	51,063,167.20	-	-	-	-	-	51,063,167.20
结算备付金	206,732.32	-	-	-	-	-	206,732.32
存出保证金	441,577.05	-	-	-	-	-	441,577.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	205,206,943.21	205,206,943.21
应收利息	-	-	-	-	-	11,663.77	11,663.77
资产总计	51,711,476.57	-	-	-	-	205,218,606.98	256,930,083.55
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,797,063.69	9,797,063.69
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,032,153.23	1,032,153.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	294,751.24	294,751.24
应付托管费	-	-	-	-	-	49,125.19	49,125.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	616,903.61	616,903.61
其他负债	-	-	-	-	-	78,222.51	78,222.51
负债总计	-	-	-	-	-	11,868,219.47	11,868,219.47
利率敏感度缺口	51,711,476.57	-	-	-	-	-193,350,387.51	245,061,864.08
上年度末 2015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	104,474,620.59	-	-	-	-	-	104,474,620.59
结算备付金	2,694,711.39	-	-	-	-	-	2,694,711.39
存出保证金	131,535.20	-	-	-	-	-	131,535.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	243,979,215.62	243,979,215.62
应收利息	-	-	-	-	-	34,409.62	34,409.62
资产总计	107,300,867.18	-	-	-	-	244,013,625.24	351,314,492.42
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,162,762.46	10,162,762.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	422,411.78	422,411.78
应付托管费	-	-	-	-	-	70,401.98	70,401.98

应付交易费用	-	-	-	-	732,717.96	732,717.96
负债总计	-	-	-	-	11,388,294.18	11,388,294.18
利率敏感度缺口	107,300,867.18	-	-	-	-232,625,331.06	339,926,198.24

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

在资产类别配置上，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括定期存款和协议存款）、股指期货、权证等金融工具，其中投资于本基金界定的互联网主题的上市公司股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2016年6月30日		上年度末 2015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	205,206,943.21	83.74	243,979,215.62	71.77
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	205,206,943.21	83.74	243,979,215.62	71.77

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（如基金成立日至期末不足一个年度的，以基金成立日至期末所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出）。		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	18,874,689.78	15,322,687.25
	-5%	-18,874,689.78	-15,322,687.25

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	205,206,943.21	79.87
	其中：股票	205,206,943.21	79.87
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	51,269,899.52	19.95
7	其他各项资产	453,240.82	0.18

8	合计	256,930,083.55	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,674,312.34	5.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	126,296,380.44	51.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,521,414.00	1.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,036,852.00	4.10
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,573,607.01	14.11
J	金融业	6,055,449.42	2.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,023,886.00	2.05
M	科学研究和技术服务业	5,025,042.00	2.05
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	205,206,943.21	83.74

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002355	兴民钢圈	531,000	11,198,790.00	4.57
2	300033	同花顺	136,500	11,117,925.00	4.54
3	002152	广电运通	461,850	7,592,814.00	3.10
4	002475	立讯精密	383,550	7,536,757.50	3.08
5	600584	长电科技	361,975	7,344,472.75	3.00
6	000333	美的集团	308,600	7,319,992.00	2.99
7	300310	宜通世纪	182,459	6,968,109.21	2.84
8	300269	联建光电	264,683	6,876,464.34	2.81
9	300410	正业科技	129,541	6,379,894.25	2.60
10	300057	万顺股份	391,288	6,319,301.20	2.58
11	600837	海通证券	392,701	6,055,449.42	2.47
12	002746	仙坛股份	142,000	5,918,560.00	2.42
13	002080	中材科技	284,858	5,719,948.64	2.33
14	002350	北京科锐	274,900	5,552,980.00	2.27
15	002439	启明星辰	210,300	5,432,049.00	2.22
16	002434	万里扬	482,200	5,246,336.00	2.14
17	000638	万方发展	216,200	5,115,292.00	2.09
18	300012	华测检测	405,900	5,025,042.00	2.05
19	300063	天龙集团	168,700	5,023,886.00	2.05
20	000028	国药一致	75,600	4,921,560.00	2.01
21	300228	富瑞特装	287,932	4,894,844.00	2.00
22	002180	艾派克	171,236	4,885,363.08	1.99
23	601799	星宇股份	99,000	4,536,180.00	1.85
24	002339	积成电子	247,900	4,521,696.00	1.85
25	002299	圣农发展	173,155	4,484,714.50	1.83
26	000568	泸州老窖	149,700	4,446,090.00	1.81
27	601689	拓普集团	133,300	4,392,235.00	1.79
28	002234	民和股份	145,224	4,271,037.84	1.74
29	300017	网宿科技	62,002	4,166,534.40	1.70
30	300299	富春通信	124,100	3,909,150.00	1.60
31	300409	道氏技术	78,000	3,732,300.00	1.52
32	300141	和顺电气	104,100	3,674,730.00	1.50
33	002733	雄韬股份	124,100	3,654,745.00	1.49
34	002308	威创股份	220,416	3,621,434.88	1.48
35	600452	涪陵电力	105,400	3,521,414.00	1.44

36	002460	赣锋锂业	104,400	3,492,180.00	1.43
37	600869	智慧能源	325,906	3,356,831.80	1.37
38	300059	东方财富	134,227	2,979,839.40	1.22

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	300033	同花顺	25,411,204.30	7.48
2	002299	圣农发展	19,462,834.90	5.73
3	000700	模塑科技	17,417,362.31	5.12
4	002475	立讯精密	14,587,341.71	4.29
5	300271	华宇软件	14,247,678.95	4.19
6	600837	海通证券	14,093,717.39	4.15
7	300048	合康变频	13,790,734.12	4.06
8	000807	云铝股份	12,248,439.08	3.60
9	002179	中航光电	11,965,491.50	3.52
10	300150	世纪瑞尔	11,870,957.22	3.49
11	002008	大族激光	11,784,502.72	3.47
12	002104	恒宝股份	11,717,279.00	3.45
13	002594	比亚迪	11,635,597.89	3.42
14	002191	劲嘉股份	11,490,562.97	3.38
15	000892	星美联合	11,369,967.06	3.34
16	002234	民和股份	11,074,104.21	3.26
17	300296	利亚德	10,367,474.80	3.05
18	002439	启明星辰	10,236,689.30	3.01
19	002373	千方科技	10,045,389.37	2.96
20	300202	聚龙股份	9,858,334.17	2.90
21	601799	星宇股份	9,849,005.15	2.90
22	002247	帝龙新材	9,745,621.72	2.87
23	002124	天邦股份	9,639,144.56	2.84
24	002285	世联行	9,606,722.50	2.83
25	002355	兴民钢圈	9,510,562.89	2.80
26	002335	科华恒盛	9,246,509.63	2.72

27	002080	中材科技	9,062,714.92	2.67
28	300017	网宿科技	8,969,087.09	2.64
29	000678	襄阳轴承	8,887,520.94	2.61
30	000858	五粮液	8,062,449.97	2.37
31	300339	润和软件	8,062,003.00	2.37
32	002321	华英农业	7,911,906.59	2.33
33	000888	峨眉山A	7,708,297.76	2.27
34	002152	广电运通	7,656,324.26	2.25
35	002477	雏鹰农牧	7,620,797.30	2.24
36	600271	航天信息	7,592,295.36	2.23
37	002582	好想你	7,352,022.26	2.16
38	000333	美的集团	7,303,223.00	2.15
39	000997	新大陆	7,253,387.00	2.13
40	600138	中青旅	7,224,338.37	2.13
41	002595	豪迈科技	7,192,795.05	2.12
42	600038	中直股份	6,900,180.00	2.03
43	600054	黄山旅游	6,898,347.19	2.03
44	000910	大亚科技	6,892,160.58	2.03
45	300274	阳光电源	6,881,279.00	2.02

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	300048	合康变频	17,740,273.00	5.22
2	000700	模塑科技	17,292,378.79	5.09
3	002299	圣农发展	15,610,981.54	4.59
4	300033	同花顺	15,326,376.51	4.51
5	300271	华宇软件	14,987,037.11	4.41
6	300327	中颖电子	13,056,839.80	3.84
7	002104	恒宝股份	12,911,684.96	3.80
8	300150	世纪瑞尔	12,696,141.80	3.73
9	300408	三环集团	12,407,782.85	3.65
10	002008	大族激光	12,221,463.08	3.60
11	002179	中航光电	11,969,947.10	3.52
12	000807	云铝股份	11,667,419.00	3.43

13	000678	襄阳轴承	11,572,967.42	3.40
14	600351	亚宝药业	11,497,224.10	3.38
15	000892	星美联合	10,996,829.18	3.24
16	300296	利亚德	10,850,307.24	3.19
17	002285	世联行	10,844,728.44	3.19
18	002594	比亚迪	10,731,200.73	3.16
19	002373	千方科技	10,560,416.50	3.11
20	600105	永鼎股份	10,297,757.98	3.03
21	002191	劲嘉股份	10,078,445.26	2.96
22	300202	聚龙股份	10,053,198.62	2.96
23	002094	青岛金王	9,856,671.36	2.90
24	002335	科华恒盛	9,773,394.00	2.88
25	002124	天邦股份	9,549,872.46	2.81
26	300031	宝通科技	9,499,358.90	2.79
27	000858	五粮液	9,239,575.79	2.72
28	002582	好想你	8,939,030.73	2.63
29	002234	民和股份	8,587,059.72	2.53
30	600054	黄山旅游	8,489,492.01	2.50
31	002368	太极股份	8,341,399.82	2.45
32	300100	双林股份	7,938,780.57	2.34
33	002247	帝龙新材	7,895,592.39	2.32
34	002321	华英农业	7,840,025.33	2.31
35	300250	初灵信息	7,719,852.10	2.27
36	600837	海通证券	7,693,132.00	2.26
37	300153	科泰电源	7,654,349.24	2.25
38	300384	三联虹普	7,428,380.00	2.19
39	002475	立讯精密	7,402,925.86	2.18
40	002477	雏鹰农牧	7,344,974.85	2.16
41	300339	润和软件	7,295,725.81	2.15
42	000910	大亚科技	7,287,272.78	2.14
43	300017	网宿科技	7,222,101.87	2.12
44	000997	新大陆	7,216,560.80	2.12
45	600038	中直股份	7,176,274.68	2.11
46	002055	得润电子	7,155,334.00	2.10
47	002595	豪迈科技	7,088,093.74	2.09
48	000888	峨眉山A	7,033,383.04	2.07
49	300146	汤臣倍健	6,994,598.42	2.06
50	300274	阳光电源	6,964,470.39	2.05

51	600079	人福医药	6,876,410.38	2.02
----	--------	------	--------------	------

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	1,048,354,726.33
卖出股票收入（成交）总额	1,045,037,421.03

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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中包括同花顺（证券代码 300033）

根据浙江核新同花顺网络信息股份有限公司于 2015 年 8 月 18 日发布的公告，于近日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对同花顺的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九名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	441,577.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,663.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	453,240.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002355	兴民钢圈	11,198,790.00	4.57	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
2,727	103,950.24	23,975,416.76	8.46%	259,496,881.99	91.54%

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	500,833.62	0.18%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年11月18日）基金份额总额	341,798,329.31
本报告期期初基金份额总额	341,798,329.31
本报告期基金总申购份额	8,814,385.71
减：本报告期基金总赎回份额	67,140,416.27
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	283,472,298.75

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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券股份有限公司	1	1,018,566,321.63	48.66%	948,592.15	49.02%	-

国泰君安证券股份有限公司	2	383,717,457.04	18.33%	357,356.93	18.47%	-
华泰证券股份有限公司	1	256,637,738.50	12.26%	239,005.85	12.35%	撤销 1 个交易单元
西南证券股份有限公司	2	225,286,622.21	10.76%	209,809.52	10.84%	-
渤海证券股份有限公司	3	86,507,333.01	4.13%	80,563.41	4.16%	-
华创证券有限责任公司	2	36,604,601.79	1.75%	26,769.04	1.38%	-
川财证券有限责任公司	2	34,922,850.38	1.67%	25,539.07	1.32%	-
恒泰证券股份有限公司	1	32,851,926.96	1.57%	30,595.50	1.58%	-
华鑫证券有限责任公司	1	14,613,369.92	0.70%	13,609.71	0.70%	-
中信建投证券股份有限公司	3	3,672,764.00	0.18%	3,420.42	0.18%	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
联讯证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

西部证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易等除股票交易外的其他证券投资交易。

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	《银华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值公 告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 4 日发生指数熔断 调整旗下基金申购、赎回等业务 办理时间的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	《银华基金管理有限公司关于旗 下场内基金在指数熔断期间暂停 申购赎回业务的提示性公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	《银华基金管理有限公司关于旗 下部分基金持有的德尔未来、文 化长城、格林美、万里扬、宏图 高科估值方法调整的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
5	《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 7 日发生指数熔断 调整旗下基金申购、赎回等业务 办理时间的公告》	本基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	《银华基金管理有限公司关于旗 下部分基金持有的海格通信、鼎 龙股份、创意信息估值方法调整 的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 8 日
7	《银华基金管理有限公司关于旗 下部分基金持有的千方科技、初	三大证券报及本基 金管理人网站	2016 年 1 月 13 日

	灵信息、万方发展估值方法调整的公告》		
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的亚太股份、旋极信息、光环新网估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
9	《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
10	《银华基金管理有限公司关于银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
11	《银华基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
12	《银华基金管理有限公司关于银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金开放银华基金淘宝直营店以及网上直销支付宝渠道的申购和赎回业务的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 27 日
13	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的宝通科技、凯撒旅游、航天科技、梅花生物估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
14	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券	三大证券报、证券日报及本基金管理	2016 年 3 月 15 日

	投资咨询有限公司网上费率优惠活动的公告》	人网站	
15	《关于增加上海凯石财富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》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 16 日
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的杰瑞股份、光线传媒、富春通信估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
17	《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
18	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的泸州老窖估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 5 日
19	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的启明星辰估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 14 日
20	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民生银行直销银行“基金通”平台费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 26 日
21	《关于增加大连银行为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 30 日
22	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 14 日

23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海联泰资产管理有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的兴民钢圈估值方法调整的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 7 月 21 日发布公告，自 2016 年 7 月 26 日起调整本基金每笔赎回申请的最低份额、转换转出最低份额及赎回后的最低保有份额。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理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办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相

关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日