银华－道琼斯88精选证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2018年8月28日

§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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§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	1,938,221,158.30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	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公司的股票，在控制与标的指数偏离风险的前提下，力求获得超越标的指数的投资收益率。 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。
业绩比较基准	道琼斯中国88指数收益率
风险收益特征	本基金是属于证券投资基金中的较高风险，较高收益的产品，其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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

2.4 信息披露方式

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

§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	48,880,882.62
本期利润	-265,307,594.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1335
本期加权平均净值利润率	-11.15%
本期基金份额净值增长率	-11.39%
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	167,285,060.91
期末可供分配基金份额利润	0.0863
期末基金资产净值	2,105,506,219.21
期末基金份额净值	1.0863
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	361.57%

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

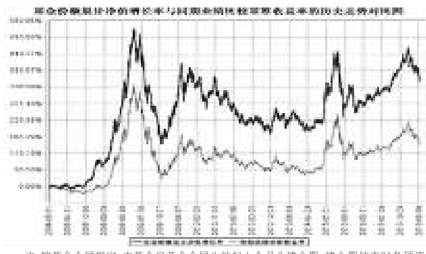
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.19%	1.16%	-7.32%	1.30%	2.13%	-0.14%
过去三个月	-7.27%	1.03%	-9.90%	1.21%	2.63%	-0.18%
过去六个月	-11.39%	1.07%	-13.55%	1.23%	2.16%	-0.16%
过去一年	0.42%	0.90%	-2.00%	1.03%	2.42%	-0.13%
过去三年	-3.02%	1.26%	-13.15%	1.46%	10.13%	-0.20%
自基金合同生效起至今	361.57%	1.50%	144.23%	1.74%	217.34%	-0.24%

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国大陆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



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，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。

§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、银华泓改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘辉先生	本基金的基金经理	2017年3月15日	2018年3月28日	17.5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。
李旻先生	本基金的基金经理	2017年11月24日	-	9年	硕士学位。2008年7月加入银华基金，历任助理行业研究员、行业研究员、研究组长、基金经理助理，现任总监助理兼基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
陈梦舒先生	本基金的基金经理	2017年12月8日	-	7年	硕士学位，曾就职于普天信息技术研究院、TechOpyoins Consulting Inc.、中国电信，2010年9月加入银华基金，历任助理行业研究员、行业研究员、研究组长、基金经理助理，现任总监助理兼基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
沈莉女士	本基金的基金经理助理	2018年5月14日	-	10.5年	硕士学位，曾就职于中泰证券股份、国泰君安证券、诺德基金、上海证券、金成培训，2016年8月入职银华基金，历任研究部策略组长、养老金投资经理助理，现任基金经理助理。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。

3、周晶女士自2018年8月13日起担任银华－道琼斯88精选证券投资基金基金经理助理。

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

从2016年开始的全球经济同步复苏在2018年上半年出现分化和波动，但复苏趋势未变。2018年上半年，美国PMI指数持续上行，欧元区、日本和中国都有一定的回落和波动，都还处于扩张区间。美联储、加拿大、英国、韩国等国相继加息，全球货币政策边际退出宽松，流动性拐点正在临近，过去10年极度宽松的流动性环境不复存在。经济和流动性环境导致全球主要资产波动率较2017年大幅提升。

上半年GDP、工业增加值与各项高频数据同比增速仍然较好，反映了中国经济的韧性较强。全球经济仍在扩张区间利好中国外需，但贸易摩擦增加了对未来出口的担心。"去杠杆严监管"政策基调下，紧信用导致实体企业融资难，社融增速一路下行，经济不确定性加大。

贸易摩擦和紧信用环境大幅降低了市场风险偏好，A股整体呈现震荡下行。截至2018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-13.3%、-13.9%、-14.3%、-8.3%。内需型、现金流好的行业体现出较强的抗跌性，有明显的相对收益，周期板块表现较差。

本基金在上半年的操作中，维持了中性偏低仓位。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，并适当降低基金仓位，进一步强化增强部分比重，相比业绩基准获得了一定的相对收益。

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1.0863元；本报告期基金份额净值增长率为-11.39%，业绩比较基准收益率为-13.55%。

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，本基金认为贸易摩擦和紧信用环境带来经济不确定性加大，但去杠杆降低了中国经济的长期尾部风险，有利于经济长远健康发展。经过二季度的快速调整，下半年市场整体大幅下杀动力已经不大。指数预计围绕当前位置宽幅震荡，自下而上的个股机会把握将更加重要，有利于进一步发挥机构投资者的选股优势。因此我们将在进一步加大增强部分的权重与自下而上个股筛选的同时，择机适度提高仓位，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历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于2018年1月11日发布分红公告，向于2018年1月15日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每10份基金份额分配红利人民币0.1000元，实际分配收益金额为人民币20,737,584.80元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本基金本报告期实施利润分配的金额为20,737,584.80元。

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－道琼斯88精选证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	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	304,170,936.37	226,145,416.03
结算备付金	2,028,446.58	3,583,822.60
存出保证金	210,640.84	152,788.67
交易性金融资产	1,803,530,781.86	2,337,592,497.86
其中：股票投资	1,803,530,781.86	2,337,592,497.86
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	-	-
买入返售金融资产	-	80,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	68,019.96	22,298.75
应收股利	-	-
应收申购款	488,342.60	395,529.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	233.25	233.25
资产总计	2,110,497,401.46	2,647,892,586.44
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	20,935,057.20
应付赎回款	1,312,958.98	3,322,013.67
应付管理人报酬	2,166,752.31	2,670,889.30
应付托管费	451,406.73	556,435.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	605,692.23	991,760.31
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	454,372.00	650,653.08
负债合计	4,991,182.25	29,126,808.84
所有者权益：		
实收基金	1,938,221,158.30	2,119,628,625.56
未分配利润	167,285,060.91	499,137,152.04
所有者权益合计	2,105,506,219.21	2,618,765,777.60
负债和所有者权益总计	2,110,497,401.46	2,647,892,586.44

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值为人民币1.0863元，基金份额总额为1,938,221,158.30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：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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-245,047,391.81	338,960,860.80
1.利息收入	2,281,497.82	3,698,320.52
其中：存款利息收入	1,033,007.89	914,124.00
债券利息收入	-	2,208,849.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,248,489.93	575,347.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	66,822,860.07	287,531,952.02
其中：股票投资收益	47,012,507.37	268,273,574.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	138,500.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,810,352.70	19,119,877.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-314,188,477.37	47,709,213.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	36,727.67	21,374.66
减：二、费用	20,260,202.94	23,129,498.72
1. 管理人报酬	14,143,734.40	14,797,381.59
2. 托管费	2,946,611.31	3,082,787.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,949,490.01	5,031,928.70
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	220,367.22	217,400.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-265,307,594.75	315,831,362.08
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-265,307,594.75	315,831,362.08

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：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)	2,119,628,625.56	499,137,152.04	2,618,765,777.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-265,307,594.75	-265,307,594.75
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)	-181,407,467.26	-45,806,911.58	-227,214,378.84
其中：1.基金申购款	51,297,049.26	10,662,924.41	61,959,973.67
2.基金赎回款	-232,704,516.52	-56,469,835.99	-289,174,352.51
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)	-	-20,737,584.80	-20,737,584.80
五、期末所有者权益(基金净值)	1,938,221,158.30	167,285,060.91	2,105,506,219.21
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)	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

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 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.2.3 差错更正的说明

无。

6.4.3 税项

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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征增值税试点的通知》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。

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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
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
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

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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
东北证券	17,888,536.92	0.93%	65,198,284.17	1.90%
第一创业	107,288,788.28	5.56%	309,984,854.58	9.03%

6.4.5.1.2 债券交易

注：无。

6.4.5.1.3 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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	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
东北证券	280,000,000.00	3.88%	440,000,000.00	9.63%
第一创业	200,000,000.00	2.77%	-	-

6.4.5.1.4 权证交易

注：无。

6.4.5.1.5 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	16,659.82	0.99%	-	-
第一创业	99,918.64	5.94%	99,918.64	16.50%
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	60,444.67	1.95%	60,719.36	2.25%
第一创业	288,690.33	9.31%	-	-

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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 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	14,143,734.40	14,797,381.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,930,071.15	1,997,150.83

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1.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%/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

6.4.5.2.2 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	2,946,611.31	3,082,787.93

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×0.25%/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

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	304,170,936.37	965,013.55	138,977,859.01	868,408.91

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.6.2 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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	1,241,750	9,310,286.86	9,275,872.50	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	-	-	102,200	1,982,219.00	1,536,066.00	-
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	28,500	375,459.00	367,650.00	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.7 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	1,803,530,781.86	85.46
	其中：股票	1,803,530,781.86	85.46
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	306,199,382.95	14.51
8	其他各项资产	767,236.65	0.04
9	合计	2,110,497,401.46	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 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	34,672,091.33	1.65
C	制造业	596,595,685.27	28.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,149,547.50	1.48
E	建筑业	42,504,402.09	2.02
F	批发和零售业	16,511,306.40	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	23,559,168.29	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,873,867.60	1.32
J	金融业	651,854,040.18	30.96
K	房地产业	85,065,419.37	4.04
L	租赁和商务服务业	9,697,558.53	0.46
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	1,519,483,086.56	72.17

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	6,206,244.30	0.29
B	采掘业	4,754,622.66	0.23
C	制造业	178,611,273.43	8.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,796,700.00	0.09
E	建筑业	3,838,144.20	0.18
F	批发和零售业	5,033,788.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	6,785,758.08	0.32
H	住宿和餐饮业	672,672.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,631,376.73	2.02
J	金融业	5,138,899.20	0.24
K	房地产业	8,500,554.55	0.40
L	租赁和商务服务业	6,370,506.65	0.30
M	科学研究和技术服务业	2,472,188.40	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	2,735,912.90	0.13
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	8,499,054.20	0.40
S	综合	-	-
	合计	284,047,695.30	13.49

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港股通股票。

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前十名股票投资明细

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	2,076,474	121,639,846.92	5.78
2	600036	招商银行	3,561,157	94,156,991.08	4.47
3	600519	贵州茅台	85,171	62,299,179.66	2.96
4	000651	格力电器	1,015,483	47,880,023.45	2.27
5	601166	兴业银行	3,195,608	46,016,755.20	2.19
6	600031	三一重工	4,941,279	44,323,272.63	2.11
7	000333	美的集团	816,893	42,658,152.46	2.03
8	000002	万科A	1,585,272	38,997,691.20	1.85
9	600016	民生银行	5,411,770	37,882,390.00	1.80
10	600000	浦发银行	3,625,023	34,655,219.88	1.65

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票信息，应阅读登载于http://www.yhfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	300188	美亚柏科	783,420	14,336,586.00	0.68
2	600486	扬农化工	217,927	12,188,657.11	0.58
3	300373	扬杰科技	385,998	11,039,542.80	0.52
4	600588	用友网络	302,000	7,402,020.00	0.35
5	002340	格林美	1,001,300	6,057,865.00	0.29

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票信息，应阅读登载于http://www.yhfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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	600031	三一重工	28,094,017.28	1.07
2	603799	华友钴业	17,906,134.00	0.68
3	002304	洋河股份	15,772,916.10	0.60
4	002027	分众传媒	14,737,780.01	0.56
5	002456	欧菲科技	12,989,059.08	0.50
6	300188	美亚柏科	12,725,533.20	0.49
7	002008	大族激光	11,520,825.54	0.44
8	600030	中信证券	11,188,604.00	0.43
9	601318	中国平安	11,061,845.00	0.42
10	002258	利尔化学	10,935,124.89	0.42
11	600196	复星医药	10,162,365.00	0.39
12	300373	扬杰科技	9,998,237.40	0.38
13	600129	太极集团	9,982,014.00	0.38
14	600486	扬农化工	9,422,517.00	0.36
15	600582	天地科技	9,364,683.00	0.36
16	600438	通威股份	9,172,020.53	0.35
17	002594	比亚迪	8,559,140.96	0.33
18	601088	中国神华	8,281,071.00	0.32
19	002045	国光电器	8,084,213.00	0.31
20	002460	赣锋锂业	7,922,053.22	0.30

注："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	002511	中顺洁柔	52,781,943.29	2.02
2	002293	罗莱生活	45,452,696.27	1.74
3	601058	赛轮金宇	34,735,809.90	1.33
4	601318	中国平安	30,001,582.52	1.15
5	002327	富安娜	21,381,064.61	0.82
6	600036	招商银行	20,018,650.30	0.76
7	601166	兴业银行	19,848,374.20	0.76
8	000661	长春高新	18,992,518.30	0.73
9	002456	欧菲科技	14,346,583.60	0.55
10	002450	康得新	13,855,456.72	0.53
11	600519	贵州茅台	13,654,161.09	0.52
12	000002	万科A	11,886,621.81	0.45
13	600438	通威股份	11,169,881.87	0.43
14	000063	中兴通讯	11,033,694.19	0.42
15	600104	上汽集团	9,780,515.73	0.37
16	000725	京东方A	9,458,186.95	0.36
17	600741	华域汽车	9,303,665.75	0.36
18	000651	格力电器	8,816,222.21	0.34
19	600129	太极集团	8,734,129.67	0.33
20	601288	农业银行	8,641,883.56	0.33

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	830,640,177.62
卖出股票收入(成交)总额	1,097,525,923.62

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浦发银行(证券代码：600000)、兴业银行(证券代码：601166)、招商银行(证券代码：600036)。

根据中国银监会于2018年1月18日发布的行政处罚信息公开表(川银监罚字〔2018〕2号)，该公司因内部控制严重失效，严重违反审慎经营规则等多种行为，已由中国银行业监督管理委员会调查完毕并依法对浦发银行股份有限公司做出行政处罚。具体内容为：罚款人民币46175万元。

根据河南银监局于2017年12月29日发布的行政处罚信息公开表(豫银监罚决字〔2017〕14号)，该上市公司因违反国家规定从事投资业务，严重违反审慎经营规则，已由中国银行业监督管理委员会调查完毕并依法对兴业银行股份有限公司郑州分行做出行政处罚。具体内容为：1.对违反国家规定从事投资业务违法行为，没收违法所得6588.246万元，并处1倍罚款，罚没合计13176.492万元。2.对严重违反审慎经营规则违法行为罚款50万元。

根据中国银监会于2018年2月12日发布的行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1号)，该公司内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等多种行为，已由中国银行业监督管理委员会调查完毕并依法对招商银行股份有限公司做出行政处罚。具体内容为：罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和分析，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	210,640.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,019.96
5	应收申购款	488,342.60
6	其他应收款	233.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	767,236.65

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
154,531	12,542.60	4,398,797.01	0.23%	1,933,822,361.29	99.77%

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	124,665.20	0.01%

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(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	2,119,628,625.56
本报告期基金总申购份额	51,297,049.26
减：本报告期基金总赎回份额	232,704,516.52
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	1,938,221,158.30

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	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券股份有限公司	5	320,437,665.66	16.62%	237,805.95	14.15%	-
华泰证券股份有限公司	5	275,546,850.00	14.29%	245,989.79	14.63%	-
广发证券股份有限公司	2	237,762,335.39	12.33%	221,427.79	13.17%	-
光大证券股份有限公司	2	211,160,329.01	10.95%	196,653.46	11.70%	-
太平洋证券股份有限公司	4	185,314,263.85	9.61%	135,519.34	8.06%	-
中信建投证券股份有限公司	1	156,746,719.27	8.13%	145,977.96	8.68%	-
长江证券股份有限公司	2	132,899,012.73	6.89%	123,768.79	7.36%	-
第一创业证券股份有限公司	2	107,288,788.28	5.56%	99,918.64	5.94%	-
中泰证券股份有限公司	1	92,307,236.18	4.79%	85,965.00	5.11%	-
天风证券股份有限公司	4	62,189,287.93	3.23%	57,916.92	3.45%	-
华创证券有限责任公司	2	52,400,299.72	2.72%	48,800.26	2.90%	-
东吴证券股份有限公司	3	32,436,556.85	1.68%	23,720.48	1.41%	-
东北证券股份有限公司	4	17,888,536.92	0.93%	16,659.82	0.99%	-
新时代证券股份有限公司	2	15,700,022.61	0.81%	14,620.50	0.87%	-
国金证券股份有限公司	2	10,077,123.46	0.52%	9,384.63	0.56%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	9,540,636.26	0.49%	8,885.08	0.53%	-
中国国际金融有限公司	2	7,409,780.12	0.38%	6,900.83	0.41%	-
海通证券股份有限公司	2	1,060,657.00	0.06%	987.77	0.06%	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	3	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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。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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券股份有限公司	-	-	160,000,000.00	2.21%	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	200,000,000.00	2.77%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	800,000,000.00	11.07%	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	2,040,000,000.00	28.24%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	710,000,000.00	9.83%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	2,065,000,000.00	28.58%	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	200,000,000.00	2.77%	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	120,000,000.00	1.66%	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	310,000,000.00	4.29%	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	280,000,000.00	3.88%	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	180,000,000.00	2.49%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	160,000,000.00	2.21%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中原证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§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

1、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。

2、本基金管理人于2018年6月11日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》，自2018年6月12日起调整本基金定期定额投资的最低金额为10元。

银华基金管理股份有限公司
2018年8月28日