

银华保本增值证券投资基金

[2017]第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月21日

§ 1.1 首要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金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责任。

基金托管人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，并于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，复核报告存于本基金管理公司住所。投资者欲了解详细情况，详见基金的招募说明书。

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。

本基金自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称 银华保本增值

交易代码 180002

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2004年3月12日

报告期末基金份额总额 3,861,742,362.92份

投资目标 在确保保本周期到期时本金安全的基础上，谋求基金资产的增值。

投资策略 在确保保本周期到期时本金安全的基础上，谋求基金资产的增值。

业债比价基准 保本期到期时的定期存款利率定期存款利率

风险收益特征 本基金在保本周期内，风险投资在资产配置中的比例不高于5%，因投资货币市场工具、股票、权证、债券、资产支持证券、基金等金融产品而取得的收益可能对冲保本周期内可能遭受的损失。

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

基金类别 创造型开放式基金

基金状态 正常

基金募集情况 \$ 3 主要财务指标/基金净值表现

(单位:人民币元)

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 5,390,388.32

2.本期利润 9,937,476.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0005

4.期末基金资产净值 3,867,976,469.30

5.期末基金份额净值 1.0016

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的余额，本期利润未考虑持有人申购或赎回费用的影响，即未扣除申购或赎回费用。

2.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如：基金的申购、赎回费等)，计入费用后实际收益率将低于所列数据。

3.1 主要财务指标

(单位:人民币元)

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 5,390,388.32

2.本期利润 9,937,476.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0005

4.期末基金资产净值 3,867,976,469.30

5.期末基金份额净值 1.0016

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的余额，本期利润未考虑持有人申购或赎回费用的影响，即未扣除申购或赎回费用。

2.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如：基金的申购、赎回费等)，计入费用后实际收益率将低于所列数据。

3.2 本基金业绩指标/基金净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业债比业债比

差率差率(%) 差率差率(%)

①-③ 0.01% 0.01%

②-④ -0.43% -0.04%

过去三个月 0.26% 0.05% 0.69% 0.05% 0.01% 0.01%

注:1.本基金业绩指标/基金净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

2.本基金业绩指标/基金净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

3.3 基金管理人报告

3.3.1 基金管理人简介

姓名 职务 任期日期 离任日期 年限

王嘉钢 基金经理 2014年9月12日 - 8年

孙慧娟 基金经理 2016年3月6日 - 6.64年

注:1.本基金的基金经理在报告期内辞职或离任的，由基金管理人按照法律法规要求聘请新的基金经理，其间由基金管理人指定的人员代为履行基金经理职责，直至新任基金经理到任。

2.证券从业的定义从广义上讲是从事证券业的人员，包括但不限于证券业从业人员。

3.4 财富管理人对报告期内基金运作的说明

基金管理人对报告期内基金运作的整体情况进行了分析。

4.1 公司治理情况

4.1.1 公司治理情况

4.1.2 公司治理制度

4.1.3 公司治理评价

4.1.4 公司治理存在的问题及整改计划

4.1.5 公司治理的优缺点

4.2 对公司治理的说明

4.2.1 公司治理的总体情况

4.2.2 公司治理的不足之处

4.2.3 公司治理的改进措施

4.2.4 对公司治理的评价

4.3 公司关联交易的说明

4.3.1 公司关联交易的总体情况

4.3.2 公司关联交易的执行情况

4.3.3 公司关联交易的定价政策

4.3.4 公司关联交易的定价依据

4.3.5 公司关联交易的定价政策

4.3.6 公司关联交易的定价政策

4.3.7 公司关联交易的定价政策

4.3.8 公司关联交易的定价政策

4.3.9 公司关联交易的定价政策

4.3.10 公司关联交易的定价政策

4.3.11 公司关联交易的定价政策

4.3.12 公司关联交易的定价政策

4.3.13 公司关联交易的定价政策

4.3.14 公司关联交易的定价政策

4.3.15 公司关联交易的定价政策

4.3.16 公司关联交易的定价政策

4.3.17 公司关联交易的定价政策

4.3.18 公司关联交易的定价政策

4.3.19 公司关联交易的定价政策

4.3.20 公司关联交易的定价政策

4.3.21 公司关联交易的定价政策

4.3.22 公司关联交易的定价政策

4.3.23 公司关联交易的定价政策

4.3.24 公司关联交易的定价政策

4.3.25 公司关联交易的定价政策

4.3.26 公司关联交易的定价政策

4.3.27 公司关联交易的定价政策

4.3.28 公司关联交易的定价政策

4.3.29 公司关联交易的定价政策

4.3.30 公司关联交易的定价政策

4.3.31 公司关联交易的定价政策

4.3.32 公司关联交易的定价政策

4.3.33 公司关联交易的定价政策

4.3.34 公司关联交易的定价政策

4.3.35 公司关联交易的定价政策

4.3.36 公司关联交易的定价政策

4.3.37 公司关联交易的定价政策

4.3.38 公司关联交易的定价政策

4.3.39 公司关联交易的定价政策

4.3.40 公司关联交易的定价政策

4.3.41 公司关联交易的定价政策

4.3.42 公司关联交易的定价政策

4.3.43 公司关联交易的定价政策

4.3.44 公司关联交易的定价政策

4.3.45 公司关联交易的定价政策

4.3.46 公司关联交易的定价政策

4.3.47 公司关联交易的定价政策

4.3.48 公司关联交易的定价政策

4.3.49 公司关联交易的定价政策

4.3.50 公司关联交易的定价政策

4.3.51 公司关联交易的定价政策

4.3.52 公司关联交易的定价政策

4.3.53 公司关联交易的定价政策

4.3.54 公司关联交易的定价政策

4.3.55 公司关联交易的定价政策

4.3.56 公司关联交易的定价政策

4.3.57 公司关联交易的定价政策

4.3.58 公司关联交易的定价政策

4.3.59 公司关联交易的定价政策

4.3.60 公司关联交易的定价政策

4.3.61 公司关联交易的定价政策

4.3.62 公司关联交易的定价政策

4.3.63 公司关联交易的定价政策

4.3.64 公司关联交易的定价政策

4.3.65 公司关联交易的定价政策

4.3.66 公司关联交易的定价政策

4.3.67 公司关联交易的定价政策

4.3.68 公司关联交易的定价政策

4.3.69 公司关联交易的定价政策

4.3.70 公司关联交易的定价政策

4.3.71 公司关联交易的定价政策

4.3.72 公司关联交易的定价政策

4.3.73 公司关联交易的定价政策

4.3.74 公司关联交易的定价政策

4.3.75 公司关联交易的定价政策

4.3.76 公司关联交易的定价政策

4.3.77 公司关联交易的定价政策

4.3.78 公司关联交易的定价政策

4.3.79 公司关联交易的定价政策

4.3.80 公司关联交易的定价政策

4.3.81 公司关联交易的定价政策

4.3.82 公司关联交易的定价政策

4.3.83 公司关联交易的定价政策

4.3.84 公司关联交易的定价政策

4.3.85 公司关联交易的定价政策

4.3.86 公司关联交易的定价政策