银华富裕主题混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25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2016年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华富裕主题混合型证券投资基金
基金简称	银华富裕主题混合
基金主代码	180012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月16日
基金管理人	银华基金管理有限公司
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	1,579,639,104.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过选择富裕主题行业,并投资其中的优势企业,把握居民收入增长和消费升级蕴含的投资机会,同时严格风险管理,实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金为主动式的混合型基金,在资产配置策略方面,一是在重点投资于富裕主题行业中优势企业的前提下实现大类资产配置, 二是对各大行业及细分行业投资评级并确定基金股票资产在各行业的配置比例;在股票选择策略方面,本基金将根据企业的成长性分析来选择股票;在债券投资策略方面,本基金将主要采取久期调整、收益率曲线配置和类属配置等策略,发现、利用市场失衡实现组合增值。 本基金的具体投资比例如下:本基金的股票投资比例为基金总资产的60%~95%,债券为0%~40%,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。对于权证及中国证监会允许投资的其他创新金融工具,将依据有关法律法规进行投资管理。本基金的股票资产中,不低于80%的资产将投资于富裕主题行业中的优势上市公司股票。同时,本基金将综合考虑宏观经济、行业景气及企业成长性等因素,以不超过20%的股票资产部分投资于富裕主题行业之外的上市公司发行的证券。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于主动式行业混合型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	2,316,831,092.51	608,990,925.67	200,531,238.04
本期利润	1,757,377,212.93	723,785,479.80	629,080,867.04
加权平均基金份额本期利润	0.7710	0.1450	0.0975
本期加权平均净值利润率	48.61%	13.88%	9.20%
本期基金份额净值增长率	40.10%	16.10%	8.87%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	1,145,730,057.06	484,216,128.03	–90,960,359.71
期末可供分配基金份额利润	0.7253	0.1245	–0.0162
期末基金资产净值	2,725,369,161.62	4,787,902,364.27	5,947,626,918.14
期末基金份额净值	1.7253	1.2315	1.0607
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	253.45%	152.29%	117.30%

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,为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、上述本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。

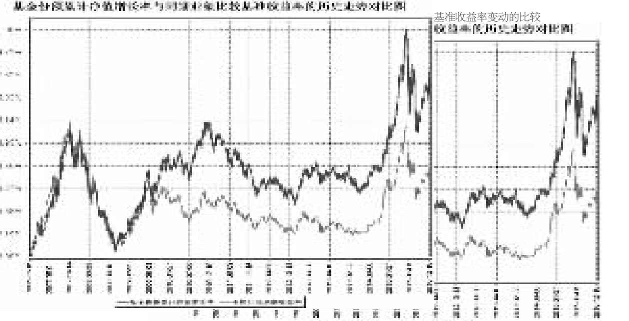
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	20.25%	1.68%	13.84%	1.34%	6.41%	0.34%
过去六个月	–8.12%	2.80%	–11.97%	2.14%	3.85%	0.66%
过去一年	40.10%	2.46%	7.38%	1.99%	32.72%	0.47%
过去三年	77.08%	1.72%	43.97%	1.43%	33.11%	0.29%
过去五年	27.24%	1.51%	24.00%	1.29%	3.24%	0.22%
自基金合同生效起至今	253.45%	1.66%	118.07%	1.56%	135.38%	0.10%

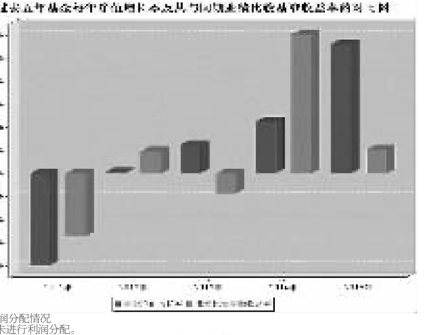
注:自2011年1月1日起,本基金业绩比较基准变更为沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于本基金属于股票型基金,一般情况下股票投资比例大约为80%,本基金采用业界较为公认、市场代表性较好的沪深300 指数和中国债券总指数加权作为本基金的

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:本基金的股票投资比例为基金总资产的60%~95%,债券为0%~40%,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的非现金基金资产中,不低于80%的资产将投资于富裕主题行业中的优势上市公司股票。同时,本基金将综合考虑宏观经济、行业景气及企业成长性等因素,以不超过20%的非现金基金资产部分投资于富裕主题行业之外的上市公司发行的证券。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于过去三年未进行利润分配。

§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2015年12月31日,本基金管理人管理着55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)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金及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。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		
周可彦先生	本基金的基金经理	2013年10月22日	–	14年	硕士学位。历任中国银河证券有限公司研究员,申万巴黎基金管理有限公司高级分析师,工银瑞信基金管理有限公司高级分析师,嘉实基金管理有限公司高级分析师,曾担任嘉实泰和价值封闭式基金基金经理职务,华夏基金管理有限公司投资经理,天弘基金管理有限公司投资部总经理,曾担任天弘精选混合型证券投资基金基金经理职务。2013年8月加盟银华基金管理有限公司。自2015年5月6日起兼任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
哈默女士	本基金的基金经理助理	2014年6月23日	2015年5月25日	7年	学士学位。2007年7月加盟银华基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员等职位,自2015年5月25日起担任银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华惠增利货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金基金经理,自2015年7月16日起兼任银华货币市场证券投资基金及银华交易型货币市场基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
唐能先生	本基金的基金经理助理	2013年10月8日	2015年5月25日	5年	硕士学位。2009年7月毕业于中国人民银行研究生部,2009年9月加盟银华基金管理有限公司,先后从事家用电器、新能源电池、农业和医药行业研究工作,自2015年5月25日起担任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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、《银华富裕主题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 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理有限公司公平交易制度》, 对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理有限公司公平交易制度》,制定了《银华基金管理有限公司公平交易执行制度 》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的日常监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照2011年8月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不掺杂任何的人为判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易,并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应,且各投资组合获得公平的交易机会;3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、本基金管理人使用恒生O3.2系统的公平交易稽核分析模块,定期及不定期进行报告分析,对公平交易的情况进行检查,以规范操作流程,适应公平交易的需要。

综上所述,本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督,来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1整体执行情况说明

报告期内,本基金管理人根据《银华基金管理有限公司公平交易制度》及相关配套制度,在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节,建立了健全有效的公平交易执行体系,公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下:

在研究分析环节,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。

在投资决策环节,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。

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,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 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%的情况有2次,这两次反向交易属于指数基金或量化专户与其他基金的同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

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

2015年,多事之秋。市场经历了史无前例的"杠杆牛"和之后的惨烈崩盘,之后是国家一些列的重拳救市政策,各类股票指数振幅剧烈。全年,上证指数上涨11.8%,沪深300上涨7.9%,创业板指数上涨85.9%。中小创再次大幅跑赢大市值股票。纵观全年,我国实体经济增长乏力,PMI、工业增加值、用电量等指标萎靡不振,央行采取多种手段定向稳健给予实体经济货币支持。人民币一改之前的生长趋势,突然相对于美元贬值,之后有加入SDR这一历史性事件,接下来人民币兑美元持续贬值,全年贬值幅度近5%。美国经济在全球范围率先复苏,美联储在接近年末启动了多年来第一次加息,一些脆弱经济体的货币发生了剧烈的向下波动。

本基金坚持价值投资的投资理念和投资框架,以自下而上为主、自上而下为辅,积极挖掘在行业竞争结构中处于有利地位、估值合理、业绩增长超预期可能性较大的个股,取得了风险调整后较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.7253元,本报告期份额净值增长率为40.10%,同期业绩比较基准收益率为7.38%。

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2016年,市场环境错综复杂,多方面存在较大的不确定性。如美联储加息的次数和幅度、注册制实施的时点和方式、2015年救市措施以何种方式回复正常、实体经济增速持续回落的时长、幅度以及是否会出现向上的拐点等等。但对A股市场有利的方面也有不少,一是愈演愈烈的"资产荒",即股票类资产相对于房地产、债券、信托、银行理财等大类资产在未来的大概率存在更好的投资价值,二是国家政策的支持,即使是注册制对证券市场长远看也是利好,三是经过上一年的股灾和一系列法规的健全,在一个投资者构成主要为散户的市场中,机构投资者的优势将越来越得到体现。

综上,本基金将继续从行业和公司的基本面角度,深入挖掘投资价值显著的投资标的,力争为基金持有人取得风险调整后好的投资回报。

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

本基金于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,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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

本基金2015年度财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:银华富裕主题混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	136,443,509.89	53,752,095.60
结算备付金	6,614,559.82	6,753,288.41
存出保证金	1,444,066.53	731,843.61
交易性金融资产	2,571,551,911.96	4,766,989,218.88
其中:股票投资	2,571,551,911.96	4,506,581,218.88
基金投资	–	–
债券投资	–	260,408,000.00
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	–	–
应收证券清算款	22,089,062.09	6,328,474.00
应收利息	34,461.59	4,181,387.71
应收股利	–	–
应收申购款	294,923.72	551,645.44
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	2,738,472,495.60	4,839,287,953.65
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	–	3,108,078.75
应付赎回款	3,734,280.12	32,905,733.44
应付管理人报酬	3,388,447.33	6,233,564.47
应付托管费	564,741.23	1,038,927.40
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	4,216,532.75	7,079,125.18
应交税费	586,684.73	586,684.73
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	612,647.82	433,475.41
负债合计	13,103,333.98	51,385,589.38
所有者权益:		
实收基金	1,579,639,104.56	3,887,814,922.74
未分配利润	1,145,730,057.06	900,087,441.53
所有者权益合计	2,725,369,161.62	4,787,902,364.27
负债和所有者权益总计	2,738,472,495.60	4,839,287,953.65

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.7253元,基金份额总额为1,579,639,104.56份。

7.2 利润表

会计主体:银华富裕主题混合型证券投资基金

本报告期: 2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	1,859,050,193.33	846,086,868.22
1.利息收入	7,036,573.29	14,290,713.77
其中:存款利息收入	1,182,547.21	1,009,813.54
债券利息收入	5,854,026.08	12,720,147.69
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	560,752.54
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	2,410,905,196.60	716,784,222.91
其中:股票投资收益	2,373,096,288.37	647,233,682.59
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–199,860.00	1,905,598.20
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	38,008,768.23	67,644,942.12
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–559,453,879.58	114,794,554.13
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	562,303.02	217,377.41
减:二、费用	101,672,980.40	122,301,388.42
1.管理人报酬	54,334,460.36	78,389,960.54
2.托管费	9,055,743.39	13,064,993.35
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	37,811,074.16	30,354,115.17
5.利息支出	–	2,950.41
其中:卖出回购金融资产支出	–	2,950.41
6.其他费用	471,702.49	489,368.95
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	1,757,377,212.93	723,785,479.80
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	1,757,377,212.93	723,785,479.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华富裕主题混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	3,887,814,922.74	900,087,441.53	4,787,902,364.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	1,757,377,212.93	1,757,377,212.93
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)	–2,308,175,818.18	–1,511,734,597.40	–3,819,910,415.58
其中:1.基金申购款	341,457,656.51	220,592,599.64	562,050,256.15
2.基金赎回款	–2,649,633,474.69	–1,732,327,197.04	–4,381,960,671.73
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)	1,579,639,104.56	1,145,730,057.06	2,725,369,161.62
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	5,607,285,423.81	340,341,494.33	5,947,626,918.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	723,785,479.80	723,785,479.80
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)	–1,719,470,501.07	–164,039,532.60	–1,883,510,033.67
其中:1.基金申购款	183,950,643.93	8,067,539.51	192,018,183.44
2.基金赎回款	–1,903,421,145.00	–172,107,072.11	–2,075,528,217.11
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)	3,887,814,922.74	900,087,441.53	4,787,902,364.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华富裕主题混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2006]181号文《关于同意银华富裕主题股票型证券投资基金的批复》的核准,由银华基金管理有限公司于2006年10月12日至2006年11月14日向社会公开发行募集,基金合同于2006年11月16日正式生效,首次设立募集规模为5,071,013,120.30份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》 及基金合同的有关规定, 经协商基金托管人同意,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起,本基金名称由"银华富裕主题股票型证券投资基金" 更名为"银华富裕主题混合型证券投资基金"。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金的股票投资比例为基金总资产的60%–95%,债券为0–40%,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。对于权证及中国证监会允许投资的其他创新金融工具,将依据有关法律法规进行投资管理。本基金的股票资产中,不低于80%的资产将投资于富裕主题行业中的优势上市公司股票。同时,本基金将综合考虑宏观经济、行业景气及企业成长性等因素,以不超过20%的股票资产部分投资于富裕主题行业之外的上市公司发行的证券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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的说明

本基金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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1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。

7.4.6.2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。

7.4.6.3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。

7.4.7 关联方关系

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
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
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
银华基金管理有限公司	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
银华财富资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	576,052,113.98	2.44%	142,288,849.51	0.73%
西南证券	1,735,967,431.55	7.35%	44,496,264.38	0.23%
第一创业	658,619,498.27	2.79%	105,693,645.80	0.54%

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31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	529,228.57	2.45%	213,491.98	5.06%
西南证券	1,607,207.68	7.43%	408,421.29	9.69%
第一创业	603,786.18	2.79%	186,086.55	4.41%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	129,539.53	0.73%	3,575.59	0.05%
西南证券	40,509.52	0.23%	40,509.52	0.57%
第一创业	96,223.42	0.54%	42,679.64	0.60%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	54,334,460.36	78,389,960.54
其中:支付销售机构的客户维护费	8,897,556.93	13,014,808.82

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1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,055,743.39	13,064,993.35

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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: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。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	136,443,509.89	1,005,614.78	53,752,095.60	869,127.70

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
000712	锦龙股份	2015年12月25日	重大事项	29.12	2016年1月4日	28.00	2,313,148	83,265,497.57	67,358,869.76	–
601377	兴业证券	2015年12月29日	重大事项	11.00	2016年1月7日	9.40	2,491,793	30,365,169.93	27,409,723.00	–
600873	梅花生物	2015年12月17日	重大事项	9.14	–	–	1,024,400	9,273,107.00	9,363,016.00	–
000430	张家界	2015年12月15日	重大事项	15.56	2016年1月14日	14.00	17,360	224,888.35	270,121.60	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应付赎回款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币2,467,150,181.60元,属于第二层次的余额为人民币104,401,730.36元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次人民币4,100,438,258.08元,第二层次人民币666,550,960.80元,无属于第三层次的余额)。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,由第一层次转入第二层次的金额为人民币59,494,487.76元(2014年度:人民币196,599,796.70元),无第二层次转入第一层次的金额(2014年度:人民币114,375,000.00元)。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(2014年度:无)。

7.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3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。

7.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月23日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,571,551,911.96	93.90
	其中:股票	2,571,551,911.96	93.90
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	143,058,069.71	5.22
7	其他各项资产	23,862,513.93	0.87
8	合计	2,738,472,495.60	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,252,302.00	0.27
B	采矿业	21,551,738.75	0.79
C	制造业	1,412,902,236.57	51.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,129,473.58	3.09
E	建筑业	107,202,858.00	3.93
F	批发和零售业	134,150,488.84	4.92
G	交通运输、仓储和邮政业	19,570,374.00	0.72
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,526,485.52	0.42
J	金融业	601,295,250.41	22.06
K	房地产业	60,972,355.52	2.24
L	租赁和商务服务业	40,536,211.66	1.49
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	70,462,137.11	2.59
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	2,571,551,911.96	94.36

8.2.2 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。

8.3 期末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	600519	贵州茅台	545,028	118,919,659.32	4.36
2	000568	泸州老窖	4,372,198	118,574,009.76	4.35
3	601166	兴业银行	5,911,800	100,914,426.00	3.70
4	600702	沱牌舍得	4,138,446	94,729,028.94	3.48
5	000858	五 粮 液	3,371,720	91,980,521.60	3.37
6	002572	索菲亚	2,057,704	88,687,042.40	3.25
7	600559	老白干酒	1,444,167	86,895,528.39	3.19
8	600809	山西汾酒	4,432,915	85,422,272.05	3.13
9	600337	美克家居	5,353,671	83,624,341.02	3.07
10	002701	奥瑞金	2,841,421	80,298,557.46	2.95

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(http://www.yhfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601628	中国人寿	426,875,196.79	8.92
2	601318	中国平安	215,130,957.74	4.49
3	601601	中国太保	212,474,468.67	4.44
4	600029	南方航空	182,086,852.21	3.80
5	600999	招商证券	180,402,338.33	3.77
6	600036	招商银行	174,223,049.73	3.64
7	601988	中国银行	168,442,338.41	3.52
8	600337	美克家居	164,471,652.31	3.44
9	000858	五 粮 液	139,588,539.21	2.92
10	000568	泸州老窖	138,727,016.63	2.90
11	601688	华泰证券	138,336,547.71	2.89
12	601111	中国国航	137,507,854.76	2.87
13	600809	山西汾酒	131,466,615.07	2.75
14	601818	光大银行	127,984,636.66	2.67
15	600019	宝钢股份	125,792,425.92	2.63
16	000002	万 科A	123,213,941.90	2.57
17	601668	中国建筑	120,583,834.08	2.52
18	600221	海南航空	118,546,808.69	2.48
19	000712	锦龙股份	116,444,425.70	2.43
20	600115	东方航空	113,370,497.20	2.37
21	601166	兴业银行	112,837,389.01	2.36
22	600694	大商股份	106,337,094.25	2.22
23	600016	民生银行	105,878,259.46	2.21
24	600804	鹏博士	101,373,392.99	2.12
25	002701	奥瑞金	100,394,186.32	2.10
26	601058	赛轮金宇	97,631,995.07	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。

8.4.2 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	002415	海康威视	491,827,488.66	10.27
2	002353	杰瑞股份	401,337,926.25	8.38
3	601628	中国人寿	367,532,602.27	7.68
4	300274	阳光电源	363,392,228.72	7.59
5	002410	广联达	337,200,448.10	7.04
6	600690	青岛海尔	303,421,730.82	6.34
7	601988	中国银行	300,675,140.12	6.28
8	600525	长园集团	247,134,547.40	5.16
9	600337	美克家居	241,550,701.28	5.05
10	601318	中国平安	239,979,376.02	5.01
11	601888	中国国旅	237,535,974.91	4.96
12	601818	光大银行	226,040,055.76	4.72
13	000581	威孚高科	221,535,082.06	4.63
14	600201	生物股份	221,376,880.50	4.62
15	002572	索菲亚	213,401,399.36	4.46
16	002482	广田股份	209,016,564.51	4.37
17	600000	浦发银行	200,885,605.36	4.20
18	600519	贵州茅台	197,938,080.54	4.13
19	600036	招商银行	197,395,584.75	4.12
20	601766	中国中车	196,871,602.99	4.11
21	601877	正泰电器	186,828,252.85	3.90
22	002202	金风科技	186,335,307.84	3.89
23	000400	许继电气	183,538,043.87	3.83
24	600029	南方航空	174,806,557.09	3.65
25	600298	安琪酵母	174,545,044.08	3.65
26	600019	宝钢股份	173,455,700.80	3.62
27	600873	梅花生物	165,562,900.83	3.46
28	601601	中国太保	164,402,347.91	3.43
29	000002	万 科A	159,984,335.50	3.34
30	600048	保利地产	158,420,306.01	3.31
31	600999	招商证券	142,128,336.22	2.97
32	600585	海螺水泥	137,563,845.93	2.87
33	601299	中国北车	135,054,290.32	2.82
34	600702	沱牌舍得	129,032,039.74	2.69
35	000069	华侨城A	128,531,994.96	2.68
36	000651	格力电器	125,091,260.32	2.61
37	601111	中国国航	117,265,172.08	2.45
38	002375	亚厦股份	116,848,631.54	2.44
39	601688	华泰证券	114,574,867.30	2.39
40	002508	老板电器	114,040,772.93	2.38
41	601058	赛轮金宇	113,127,815.12	2.36
42	601872	招商轮船	112,301,167.75	2.35
43	600115	东方航空	111,119,197.57	2.32
44	600221	海南航空	109,804,234.76	2.29
45	600694	大商股份	104,351,827.72	2.18
46	600837	海通证券	99,401,664.05	2.08
47	000024	招商地产	98,674,506.00	2.06
48	000333	美的集团	98,344,188.71	2.05
49	600016	民生银行	97,459,045.35	2.04

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。

8.4.3 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	9,936,107,767.36
卖出股票收入(成交)总额	13,684,498,653.07

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。

8.5 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。

8.6 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:本基金本报告期末仅持有上述债券

8.7 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。

8.8 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:本基金本报告期末及上年度末均未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	1,444,066.53
2	应收证券清算款	22,089,062.09
3	应收股利	–
4	应收利息	34,461.59
5	应收申购款	294,923.72
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,862,513.93

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
116,433	13,566.94	14,388,230.47	0.91%	1,565,250,874.09	99.09%

9.2 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	34,724.92	0.00%

9.3 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。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2006年11月16日)基金份额总额	5,071,013,120.30
本报告期期初基金份额总额	3,887,814,922.74
本报告期基金总申购份额	341,457,656.51
减:本报告期基金总赎回份额	2,649,633,474.69
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	1,579,639,104.56

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于2015年6月10日发布公告,凌宇翔先生自2015年6月8日起担任本基金管理人副总经理,代为履行督察长职务。

本基金管理人于2015年7月25日发布公告,自2015年7月24日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长,凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 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,报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬共计人民币90,000.00元。目前,该审计机构已为本基金连续提供了9年的服务。

11.6 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国金证券股份有限公司	2	2,575,853,267.76	10.91%	2,371,524.58	10.96%	–
民生证券股份有限公司	2	2,127,967,687.22	9.01%	1,945,033.22	8.99%	–
东方证券股份有限公司	2	1,883,893,543.27	7.98%	1,715,095.88	7.93%	–
西南证券股份有限公司	1	1,735,967,431.55	7.35%	1,607,207.68	7.43%	–
兴业证券股份有限公司	3	1,687,216,418.70	7.14%	1,540,278.72	7.12%	–
光大证券股份有限公司	2	1,386,437,475.88	5.87%	1,262,210.09	5.83%	–
招商证券股份有限公司	2	1,309,852,242.39	5.55%	1,193,337.49	5.52%	–
中银国际证券有限责任公司	2	1,246,311,012.86	5.28%	1,141,583.93	5.28%	–
广发证券股份有限公司	2	1,183,376,791.68	5.01%	1,089,341.80	5.04%	–
华泰证券股份有限公司	5	713,408,015.55	3.02%	649,482.61	3.00%	新增2个席位
第一创业证券股份有限公司	2	658,619,498.27	2.79%	603,786.18	2.79%	–
东吴证券股份有限公司	3	630,759,437.45	2.67%	587,427.03	2.72%	新增2个席位
长江证券股份有限公司	2	611,662,236.57	2.59%	556,855.61	2.57%	–
中信证券(山东)有限责任公司	1	585,993,382.70	2.48%	534,181.05	2.47%	–
东北证券股份有限公司	3	576,052,113.98	2.44%	529,228.57	2.45%	–
方正证券股份有限公司	5	564,985,544.91	2.39%	501,358.11	2.32%	新增4个席位
中信建投证券股份有限公司	1	506,761,991.44	2.15%	461,355.67	2.13%	–
新时代证券股份有限公司	2	413,379,667.95	1.75%	384,980.91	1.78%	新增1个席位
安信证券股份有限公司	3	361,951,061.07	1.53%	337,086.20	1.56%	–
华宝证券有限责任公司	1	359,367,885.78	1.52%	331,109.70	1.53%	–
湘财证券股份有限公司	1	353,855,014.95	1.50%	322,148.97	1.49%	–
中泰证券股份有限公司	1	297,030,735.71	1.26%	270,416.18	1.25%	–
海通证券股份有限公司	2	248,374,073.34	1.05%	226,119.84	1.05%	–
申万宏源集团股份有限公司	2	220,715,884.60	0.93%	200,940.00	0.93%	–
中国银河证券股份有限公司	1	206,467,291.19	0.87%	192,283.25	0.89%	–
长城证券股份有限公司	3	203,056,968.55	0.86%	184,862.68	0.85%	–
东兴证券股份有限公司	2	192,183,415.61	0.81%	178,980.37	0.83%	–
上海华信证券有限责任公司	1	169,572,414.39	0.72%	157,922.91	0.73%	–
国泰君安证券股份有限公司	2	131,262,568.09	0.56%	119,654.89	0.55%	–
中信证券股份有限公司	3	119,810,638.43	0.51%	109,074.59	0.50%	–
国信证券股份有限公司	3	103,372,352.41	0.44%	94,110.02	0.44%	–
广州证券有股份有限公司	1	77,336,423.04	0.33%	70,407.32	0.33%	–
开源证券股份有限公司	2	75,888,326.09	0.32%	70,674.52	0.33%	新增1个席位
华创证券有限责任公司	2	59,999,134.75	0.25%	54,623.20	0.25%	–
渤海证券股份有限公司	1	40,984,883.42	0.17%	38,169.01	0.18%	–
平安证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
红塔证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
太平洋证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中国民族证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
瑞银证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	2	–	–	–	–	–
江海证券有限公司	2	–	–	–	–	–
德邦证券有股份有限公司	1	–	–	–	–	–
上海证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
华安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
首创证券有限责任公司	2	–	–	–	–	–
华福证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
日信证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
东莞证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中原证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
西部证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
北京高华证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
华融证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国都证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–

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。

11.7.2 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、债券回购交易和权证交易。

银华基金管理有限公司
2016年3月25日