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

银华中国梦30股票型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月29日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中国梦30股票型证券投资基金
基金简称	银华中国梦30股票
基金主代码	001163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月29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	1,843,224,768.71份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极寻找由中国经济发展模式调整和经济增长方式转型而带来的投资机会,投资于引领和符合这个转型过程,有望在实现“中国梦”过程中成长为中国经济未来最等的优质公司,在严格控制投资组合风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在运用资产配置策略确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险的基础上,精选经济转型中符合“整线梯、新模式、新发展”方向,具有良好的公司治理水平、具备可持续增长潜力和合理估值水平的上市公司,通过集中投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险和预期收益水平高于混合型证券投资基金、债券型证券投资基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	田睿
	联系电话	(010)58163000	010 67595096
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tianejing1.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住所

§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4月29日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-124,853,056.73
本期利润	-18,058,656.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0075
本期加权平均净值利润率	-0.77%
本期基金份额净值增长率	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	-67,781,564.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0368
期末基金资产净值	1,859,206,020.48
期末基金份额净值	1.009
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	0.90%

注:1.本期末可实现收益为本期利息收入、投资收益、其他收入大于公允价值变动及资产处置损失费用后的余额,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.期末可供分配利润未用期末资产净值减本分配利润后的金额计算。
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。
4.本基金合同生效日为2015年4月29日,2015年度主要财务指标的计算期均为2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

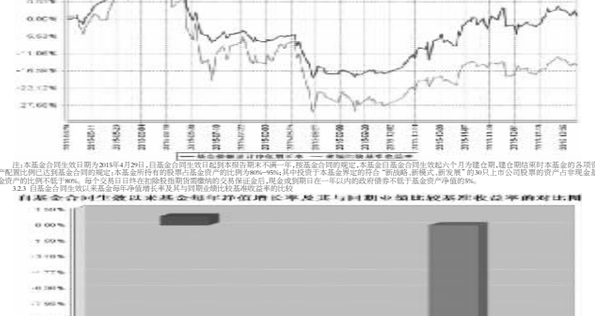
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及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	21.86%	2.01%	17.19%	1.55%	4.67%	0.46%
过去六个月	-1.08%	1.72%	-13.66%	2.47%	12.58%	-0.75%
自基金合同生效起至今	0.90%	1.81%	-14.95%	2.51%	15.85%	-0.70%

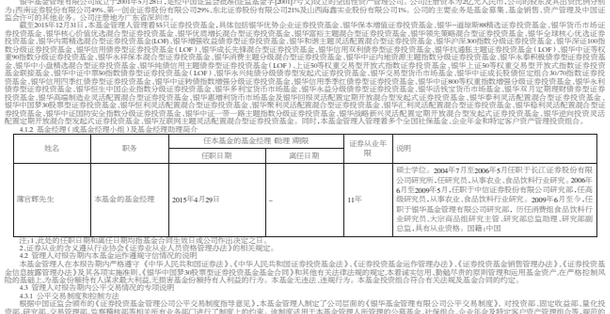
注:1.业绩比较基准为中证800指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%。中证800指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市场公司的整体状况的指数,中证800指数的成份股由沪深300指数成份股、中证500指数成份股组成,成份股覆盖了沪深证券市场的大、中、小盘股,具有良好的市场代表性。中债总财富指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益品种,具有广泛的市场代表性,能够较为客观地反映债券市场的总体走势。

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:a.基金合同生效日期为2015年4月29日,自基金合同生效日起到本报告期末不满一年,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例均达到基金合同的规定;本基金的投资组合比例符合本基金合同生效后两个完整自然年度的有关各项规定:投资于股票类资产的比例为60%-95%,其中投资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,规范的证券投资基金资产的比例不低于净值的80%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较



注:a.自基金合同生效日起至本报告期末基金份额累计净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准收益率为-14.95%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其投资管理简介

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26日,是经中国证监会批准设立基金字[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%、中国长江三峡集团公司20%、东北证券股份有限公司20%、长江证券股份有限公司11%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理和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,本基金管理人管理银华证券投资基金,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、银华一利债聚900基金证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华债券市场证券投资基金、银华核心价值优选股票证券投资基金、银华深证100指数证券投资基金、银华深证主题投资证券投资基金(LOF)、银华现代农业股票证券投资基金、银华内需精选股票证券投资基金(LOF)、银华中证800医药指数分级证券投资基金、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、银华中证500指数证券投资基金、银华永祥保本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、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金(LOF)、上证50精选交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重指数增强分级证券投资基金、银华中证500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、银华永利一年定期开放债券型证券投资基金、银华中证800金融指数分级证券投资基金、银华中证500医药卫生指数分级证券投资基金、银华沪深300等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利灵活配置混合型证券投资基金、银华鹏翔灵活配置混合型证券投资基金、银华永利定期开放混合型发起式证券投资基金、银华永利灵活配置混合型证券投资基金、银华永利灵活配置混合型证券投资基金、银华中证800证券公司指数分级证券投资基金、银华中证500银行指数分级证券投资基金、银华永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、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永利灵活配置混合型证券投资基金、银华永利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公募证券基金,此外还为特定客户资产管理提供组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛宵辉先生	本基金的基金经理	2015年4月29日	-	11年	硕士学位。2004年7月至2006年3月任职于长江证券股份有限公司研究所,任研究员,从事农业、食品饮料行业研究。2006年6月至2009年5月,任职于中证证券投资有限公司研究部,任高级研究员,从事农业、食品饮料行业研究。2009年6月至今,任职于银华基金管理有限公司研究部,历任消费组食品饮料行业研究员、大宗商品组研究主管、研究部总监助理、研究部副总监,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管理人做出决定的日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的有关规定。
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》及其各项实施细则、《银华中国梦30股票型证券投资基金合同》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,为持有人的最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金无违法、违规行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行情况

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》,对投资前、固定收益前、量化投资前、研究员、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门的管理、操作流程作了明确、规范的规定。公司层面的公平交易制度,规范了公司旗下所有投资组合在投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动环节的公平对待。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资行为的执行过程,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》、《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处理机制;并确立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。

可转债T+1日价格折算公式:(收盘价+应计利息)/100*面值。

本基金管理人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间日反向交易的控制,并增加了本基金管理人内部控制的要求,其体现形式为:1.交易所市场的公平交易功能设置与交易系统实现,不物理区别的人为干预;所有交易均通过特定投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易顺序自动启动;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般市场外协议交易、二级市场交易,并确保非集中竞价交易指令在同一时点,且交易价格在获得公平的交易机会;3.对于部分债券一般市场外协议,参公管理人管理的银行间交易指令,公平交易指令通过特定投资系统,以公平的交易顺序,自动分别发送给交易对手,以保证交易顺序的公平性;4.本基金管理人使用恒生O32系统的公平交易模块分析模块,定期及不定期进行报告分析,对公平交易的顺序进行检查,并对异常情况进行分析报告,并提出改进建议。

经上所述,本基金管理人通过事前和事后的制度、事中监控实施实时、有效、全程、全面的公平交易管理,实现了公平交易的目的。

4.3.2 公平交易的执行情况

4.3.2.1 整体交易执行情况说明

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,公平执行所有投资组合的交易指令。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,本基金管理人投资决策委员会严格按照本基金管理人的各项投资管理制度和投资权限制度,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投资决策情况进行分析,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98%)和溢价率占比频率等方面进行了等价交易分析,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 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

回顾2015年证券市场走势,波动性较大,改革和创新是主要的特征。2015年全年,央行连续五次大幅降息和降低存款准备金率的措施,开通过其他的方式保持市场的流动性,降低社会的融资成本,为经济发展和转型提供动力。在另一方面,股权行政立、“一带一路”也出台规划,国企改革、“十三五”规划和“大众创业、万众创新”的政策,正在为中国经济寻找新的增长点。但是国内有效需求不足,产能过剩状况依然比较突出,经济增速提高尚未见到迹象。

一年证券市场的特征被称“杠杆”带来的剧烈波动。上半年投资者“加杠杆”导致股指大幅上涨,以上证指数为例,从年初的3258点上涨到6月初的5176点,以“互联网+”为代表的股票涨幅巨大。监管部门从六月份开始强力“去杠杆”,带动了指数出现了快速的下跌,最低跌到3373点。2015年8月份叠加了对“汇改”带来的风险,导致市场再次出现快速下跌,再次下跌到2850点。在政府有效控制对市场及时实施了救助,以后下跌的幅度较前次比较大,幅度达到了三个月的时间。在经历了一定的幅度的反弹,最高反弹到3663点。目前的股指处于一个比较稳定的状态。

整个市场带来了较大的震撼。

本基金成立于2015年4月29日,基于对市场走势较为准确的判断,我们因时的控制了基金的仓位,在成立之初即低仓位累计安全垫,去杠杆初期快速降低仓位,在七月间保持低仓位,九月底开始快速提高仓位,并且在投资结构上进行了良好的布局,精选优质企业,在整个报告期内,本基金不仅跑赢了金融比较基准,获得一定的超额收益,期末基金净值也回到了前值以上。

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1.009元,本报告期份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准收益率为-14.95%。

4.4.3 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,我们认为国内经济增长取决于一系列改革措施的推进。从总体来看,发达国家经济复苏力度国经济发展提供良好的外围环境。2016年美国经济将继续保持较为乐观,虽然美联储在2015年12月第一次加息,但是经济复苏的势头不减,美联储在第2016年不次加息,预计美国经济将在六需不振,产能过剩的背景下更依赖于改革措施的推进。2016年是“十三五”规划的开局之年,也是推进结构性改革的攻坚之年,“十三五”规划发布新的蓝图等来新的发展机遇;中央经济工作会议提出,抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板六大任务,推进供给侧改革,改革是全国某一定的阵痛,但是只要改革顺利不障碍,发展的动力总是会聚集,国内经增速有望在一系列改革措施的推进下保持稳定。从全年看,2016宏观经济也有一些不确定性,最大的不确定性来自于中国经济和美国经济发展不同步的风险,比如美国的压力,当然国内应该的存款准备金率的降低说,同时在土储备行热投多,仍然有足够的力量应对汇率贬值给国内经济带来的压力。

展望2016年证券的投资市场,结构性的机会应该是可行的选择,选成结构性的机会主要取决有两个,从市场内部来看,经过2015年创业板估值的大幅提升,市场有内在调整的需要;从外部成分性来看,因为降息应回不大,汇率贬值导致资本外流,使得2016年流动性宽松的程度比2015年降低。结构性的机会主要来自以下三个方面,首先是受益于供给侧改革,在去库存、去产能过程受益的企业,第二是股价调整充分目的业绩增长超预期的成长股,第三是受益于人口老龄化和消费升级的消费品行业。我们相信随着以上的三个方面机会出现好的企业,相信这种结构性的机会。

展望本基金未来的操作,我们将积极调整仓位结构,精选个股,重点投向在实现中国梦过程中真正成为支柱企业的上市公司,争取实现基金资产的保值增值。

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,基金估值程序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、年中和年末的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、推荐基金估值业务、估值委员会委员参加估值业务会议,参与估值方法的研究、推荐、决策,并对估值方法的变更提出建议。估值委员会不介入具体的估值方案的制定工作和具体的估值业务。

参与估值流程各方之间不存在任何利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内收益基金合同的约定和基金运作情况,未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情况的说明

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况。

§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,不存在擅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4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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:银华中国梦30股票型证券投资基金

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
资 产:	
银行存款	324,718,551.15
结算备付金	8,097,223.92
存出保证金	2,979,493.67
交易性金融资产	1,662,625,119.83
其中:股票投资	1,662,625,119.83
衍生金融资产	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	71,691.26
应收股利	-
应收申购款	166,713.74
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,998,658,793.57
负债和所有者权益	本期末 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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	122,691,877.35
应付赎回款	7,270,476.74
应付管理人报酬	2,555,850.32
应付托管费	425,975.06
应付销售服务费	-
应付交易费用	6,382,157.32
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	126,436.30
负债合计	139,452,773.09
所有者权益:	
实收基金	1,843,224,768.71
未分配利润	15,981,251.77
所有者权益合计	1,859,206,020.48
负债和所有者权益总计	1,998,658,793.57

注:(1)报告截止日2015年12月31日,银华中国梦30股票型证券投资基金份额净值人民币1.009元,基金份额总额1,843,224,768.71份。
(2)本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:银华中国梦30股票型证券投资基金

本报告期:2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	36,805,126.79
1.利息收入	7,600,309.37
其中:存款利息收入	5,154,132.77
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	2,445,976.60
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-79,509,540.44
其中:股票投资收益	-82,543,375.26
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	3,033,834.82
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	106,794,400.24
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,920,157.62
减:二.费用	54,863,783.28
1.管理人报酬	23,644,433.84
2.托管费	3,940,738.98
3.销售服务费	-
4.交易费用	27,149,493.35
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	129,117.11
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-18,058,656.49
减:所得税费用	-
四.净利润(亏损以“-”号填列)	-18,058,656.49

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华中国梦30股票型证券投资基金

本报告期:2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月29日(基金合同生效日)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)	2,660,777,422.23	-	2,660,777,422.23
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,058,656.49	-18,058,656.49
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-817,552,653.52	34,039,908.26	-783,512,745.26
其中:1.基金申购款	102,477,550.07	-5,849,392.56	96,628,157.51
2.基金赎回款	-920,030,203.59	39,889,300.82	-880,140,902.77
四.本期向投基分份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)	1,843,224,768.71	15,981,251.77	1,859,206,020.48

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 龚凤____

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

银华中国梦30股票型证券投资基金(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”)证监许可[2015]402号《关于准予银华中国梦30股票型证券投资基金注册的批复》的注册,由银华基金管理有限公司于2015年4月13日至2015年4月24日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2015)验字第60468687_A24号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年4月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币2,660,086,478.37元,有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币600,943.86元。以上实收基金合计为人民币2,660,777,422.23元,折合2,660,777,422.23份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为有价证券的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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)、债券、中期票据、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)、股指期货与权证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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为80%-95%;其中投资于本基金界定的符合“新战略、新模式、新发展”的A/H上市公司股票的资产占股票投资组合比例不低于90%。每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。金融比较基准:中证800指数收益率×90%+中债总财富指数收益率×10%。

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,对于在其他会计核算和信息披露方面,也为“中国证券投资基金业协会核订开发的证券投资基金核算业务指引(试行)”(以下统称“证券投资基金核算业务指引”)、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准(试行)》(以下统称“XBRL分类标准”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第9号——证券投资基金年度报告内容与格式准则》(以下统称“证券投资基金年度报告内容与格式准则”)、《证券投资基金信息披露编报规则第3号(试行)——证券投资组合的编制及披露》、《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4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具按照成本或者金融资产或负债(或者一组金融资产或负债)的公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产或其他金融负债的基础上,以本基金管理人对其的管理意图和其现金流量特征为依据,在初始确认时对其进行分类。

(1)金融资产

本基金的金融资产于初始确认时分为以下四类: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、持有至到期投资、可供出售金融资产。

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

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、贷款和应收款项。

7.4.4.4 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利息,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损益;

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,且符合金融资产终止确认条件的,终止确认该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;

买入常息债券利息第一次转达本付息的附息债券,根据发行价、到期价和发行期限按直线法摊算内含票面利率息,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办法(3)中相关原则进行计量。

5)回购协议

本基金按每日的回购协议(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)在实际持有期内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的公允价值确定原则

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该资产或负债的定价时为实现其经济利益最大化的假设进行定价。

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,是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,按照活跃市场中的报价确定其公允价值。对于证券交易所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重大变化且证券发行机构财务状况未发生重大变化的情况下,使用不可观察输入值,以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获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的不能客观反映该公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最低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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 买回业务

买回业务对外发行的基金份额买回所对应的金额,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净值转换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。

7.4.4.8 摊销平准金

摊销平准金包括已实现摊销平准金和未实现摊销平准金,已实现摊销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,未实现摊销平准金指