

# 银华量化智慧动力灵活配置混合型 证券投资基金

(原银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金)

## 2016 年第 2 季度报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 7 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“本基金合同”）、《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》的规定，于 2016 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金管理人于 2016 年 3 月 28 日 15:00 起至 2016 年 4 月 15 日 17:00 止期间以通讯方式召开了银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型有关事项的议案》。本基金管理人于 2016 年 4 月 25 日发布了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

根据生效的基金份额持有人大会决议，自 2016 年 4 月 25 日起《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效且《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，同时基金更名为“银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金”。基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关约定为准。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止（注：银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金报告期为自 2016 年 4 月 1 日起至 2016 年 4 月 24 日（《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效前日）止）。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	银华量化智慧动力灵活配置混合
交易代码	000062

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 25 日
报告期末基金份额总额	10,300,305.10 份
投资目标	综合使用多种量化策略指导资产配置和选股，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	<p>本基金在投资的过程中，将量化策略贯彻到资产配置和选股中。在大类资产配置过程中，本基金密切关注反映宏观经济走向的相关数据，包括货币供应量、流动性、先导行业景气度、库存周期、PMI、工业生产增速、通胀水平等。在此基础上，本基金运用量化模型对上述各项指标的时间序列与股票市场指数时间序列的领先、滞后关系进行检验，选出其中关系显著、稳定且符合经济学、金融学原理的指标，作为能较好判断股市预期表现的指标。</p> <p>此外，本基金还将通过量化的手段，对表征市场情绪和资金流向的诸多指标的时间序列与股票市场指数的时间序列的领先、滞后关系进行检验。这些指标包括基金平均仓位、期指高频数据、股票账户活跃度、分析师多空情绪等。</p> <p>在综合考虑上述两方面因素的基础上，本基金将对权益类资产、固定收益类资产和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态的调整，力求实现投资组合动态管理最优化。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种，其风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
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

## 转型前：

基金简称	银华成长股债 30/70 指数
交易代码	000062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 22 日
报告期末基金份额总额	11,007,264.31 份
投资目标	本基金力争对中证银华成长股债恒定组合

	30/70 指数进行有效跟踪，并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法，按照成份证券在标的指数中的组成及其基准权重构建投资组合，以拟合、跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数成份证券及其权重的变动而进行相应调整。基金的投资组合比例为：本基金投资于中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产的 90%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金所持有的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%。
业绩比较基准	中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数收益率 $\times 95\% +$ 银行活期存款利率 (税后) $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种，其风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（2016 年 4 月 25 日 — 2016 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-175,112.40
2. 本期利润	-202,179.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0189
4. 期末基金资产净值	12,868,495.65
5. 期末基金份额净值	1.249

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、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。

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前
	报告期（2016年4月1日—2016年4月24日）
1. 本期已实现收益	-26,387.28
2. 本期利润	-121,738.80
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0110
4. 期末基金资产净值	13,963,470.57
5. 期末基金份额净值	1.269

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、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。

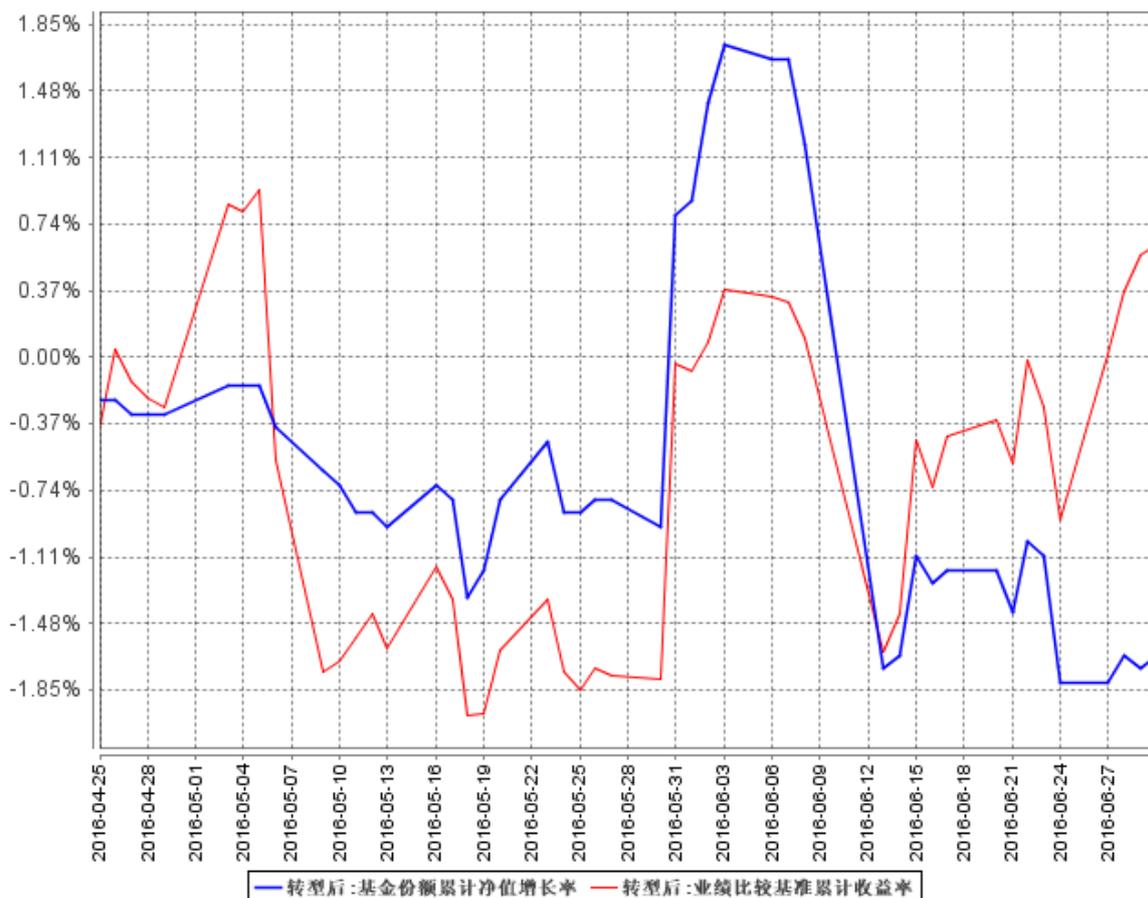
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2016年4月25日至2016年6月30日	-1.58%	0.56%	0.63%	0.59%	-2.21%	-0.03%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



本基金（转型后）合同生效日期为2016年4月25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，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定：股票投资比例为基金资产的0%–95%，权证投资比例为基金资产净值的0%–3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

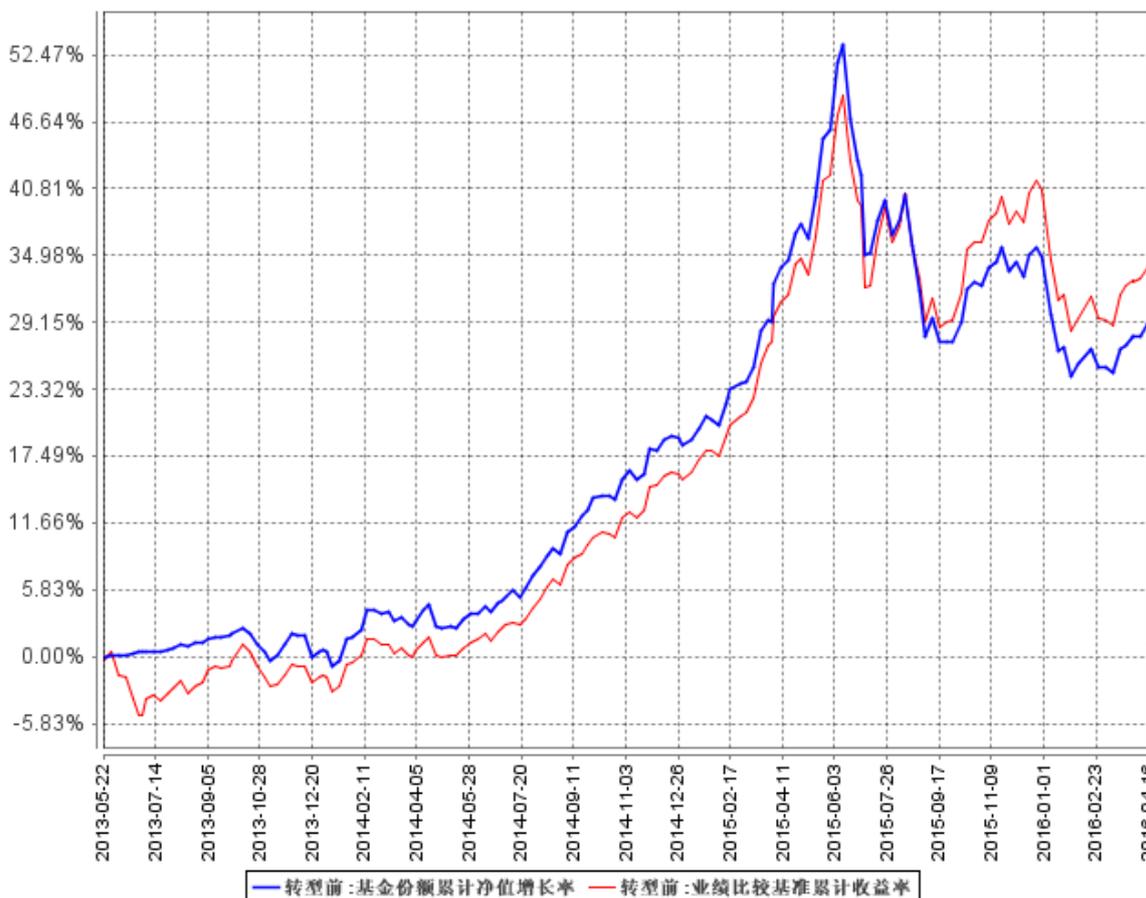
## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2016年 4月1日 至 2016年 4月24日	-0.86%	0.40%	-1.00%	0.46%	0.14%	-0.06%

### 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



按基金合同的规定，本基金（转型前）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已达到基金合同的规定：本基金投资于债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有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%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2013年5月22日	2016年4月25日	7年	硕士学位。毕业于中国人民大学。2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司

					司量化投资部研究员及基金经理助理等职，自 2011 年 9 月 26 日起至 2014 年 1 月 6 日期间担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2014 年 1 月 7 日起兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金（由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型）基金经理，自 2012 年 8 月 23 日起兼任上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2012 年 8 月 29 日起兼任银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
葛鹤军先生	本基金的基金经理	2014 年 10 月 8 日	2016 年 4 月 25 日	6 年	博士学位。2008 年至 2011 年就职于中诚信证券评估有限公司、中诚信国际信用评级有限公司。2011 年 11 月加盟银华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月 8 日起兼任银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金（LOF）、银华信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2015 年 4 月 24 日起兼任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华恒利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月 17 日起兼任银华信用双利债券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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
张凯先生	本基金的基金经理	2016 年 4 月 25 日	-	6 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自

					2012 年 11 月 14 日起兼任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任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》及其各项实施准则、《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》、《银华量化智慧动力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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金使用量化策略进行资产配置和股票投资，并辅以固定收益投资和股指期货等衍生品进行收益增强。报告期内，本基金自 4 月下旬建仓的过程中，多次内外部事件冲击使得我们的策略经历了几乎最不适应的市场环境，进而导致净值遭受了一定程度的损失，但策略的绩效表现仍在我们的预期之内。我们将继续勤勉投资，力争获得超越基准指数的收益率。

过去的—个季度，A 股市场在—系列内部和外部事件的冲击下，出现较大的震荡。在季度初随着权威人士讲话对大幅度经济刺激的否定及—系列金融经济数据回落的背景下，投资者对国内全面进入货币宽松的高预期落空，—季度反弹行情也宣告结束；随后 A 股是否纳入 MSCI 指数、人民币贬值预期、英国退欧等—系列事件，都对股票市场的走势短期产生了较大的影响。但在多种偏负面的因素影响下，A 股市场逐渐止住跌势、顽强上行，表现颇为强势。

展望下半年，随着英国退欧的短期负面影响逐步被投资者消化甚至淡忘，人民币汇率在央行的强势干预下稳定有序的区间波动，叠加上即将到来的一段宏观经济和公司财报数据的真空蜜月期，A 股市场有望在三季度有较为强势的表现。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.249 元，本报告期（2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日）份额净值增长率为-1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.63%。

截至 2016 年 4 月 24 日，银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金份额净值为 1.269 元，本报告期（2016 年 4 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日）份额净值增长率为-0.86%，同期业绩比较基准收益率为-1.00%。报告期内，基金日均跟踪误差控制在 0.35% 之内，年化跟踪误差控制在 4% 之内。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内（2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日），银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日。

报告期内（2016 年 4 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日）银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2015 年 2 月 4 日至 2016 年 4 月 24 日。银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金已通过召开份额持有人大会的方式，于 2016 年 4 月 25 日转型为银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金。

## §5 投资组合报告

转型后：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,481,013.31	26.33
	其中：股票	3,481,013.31	26.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,519,050.00	11.49
	其中：债券	1,519,050.00	11.49
	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	1,203,080.36	9.10
8	其他资产	7,018,402.24	53.08
9	合计	13,221,545.91	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。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	28,976.00	0.23
B	采矿业	35,761.00	0.28
C	制造业	1,888,521.58	14.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,549.00	0.14
E	建筑业	99,610.96	0.77
F	批发和零售业	72,114.79	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	16,740.96	0.13

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	778,435.00	6.05
J	金融业	149,666.00	1.16
K	房地产业	46,434.99	0.36
L	租赁和商务服务业	55,274.03	0.43
M	科学研究和技术服务业	24,760.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	31,551.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	74,775.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	148,459.00	1.15
S	综合	11,384.00	0.09
	合计	3,481,013.31	27.05

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000728	国元证券	4,400	73,568.00	0.57
2	300017	网宿科技	600	40,320.00	0.31
3	300104	乐视网	700	37,037.00	0.29
4	300431	暴风集团	500	36,250.00	0.28
5	300059	东方财富	1,400	31,080.00	0.24
6	601989	中国重工	4,900	31,017.00	0.24
7	300182	捷成股份	1,800	30,798.00	0.24
8	300253	卫宁健康	1,200	29,640.00	0.23
9	300147	香雪制药	2,000	29,460.00	0.23
10	300498	温氏股份	800	28,976.00	0.23

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,519,050.00	11.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,519,050.00	11.80

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019504	15 国债 04	15,000	1,519,050.00	11.80

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 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。

### 5.10 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,969.27
2	应收证券清算款	7,001,477.78
3	应收股利	-

4	应收利息	13,955.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,018,402.24

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000728	国元证券	73,568.00	0.57	重大事项

#### 5.11.6 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

转型前：

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,204,597.95	20.29
	其中：股票	3,204,597.95	20.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,806,350.00	74.77
	其中：债券	11,806,350.00	74.77
	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	628,103.58	3.98
8	其他资产	151,386.69	0.96
9	合计	15,790,438.22	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。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	40,066.56	0.29
B	采矿业	90,906.58	0.65
C	制造业	2,013,629.52	14.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,816.81	0.62
E	建筑业	74,759.26	0.54
F	批发和零售业	167,226.15	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	111,348.74	0.80
H	住宿和餐饮业	5,626.24	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	154,938.85	1.11
J	金融业	29,837.16	0.21
K	房地产业	207,785.44	1.49
L	租赁和商务服务业	43,879.92	0.31
M	科学研究和技术服务业	25,294.73	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	30,978.42	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,353.60	0.18
R	文化、体育和娱乐业	38,131.70	0.27
S	综合	58,018.27	0.42
	合计	3,204,597.95	22.95

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	1,686	51,321.84	0.37
2	300072	三聚环保	1,689	43,052.61	0.31
3	600521	华海药业	1,341	36,837.27	0.26
4	601012	隆基股份	2,979	36,343.80	0.26
5	600376	首开股份	3,185	33,219.55	0.24
6	000661	长春高新	287	29,618.40	0.21
7	600881	亚泰集团	5,126	29,013.16	0.21

8	002018	华信国际	2,242	27,890.48	0.20
9	600879	航天电子	1,773	27,126.90	0.19
10	002311	海大集团	1,715	26,925.50	0.19

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,548,650.00	61.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,257,700.00	23.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债（可交换债）	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	11,806,350.00	84.55

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019518	15 国债 18	55,000	5,499,450.00	39.38
2	018002	国开 1302	30,000	3,257,700.00	23.33
3	019504	15 国债 04	30,000	3,049,200.00	21.84

注：本基金 2016 年 4 月 24 日仅持有上述三只债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 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。

## 5.10 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	230.85
2	应收证券清算款	3,928.48
3	应收股利	-
4	应收利息	147,227.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151,386.69

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金 2016 年 4 月 24 日未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000661	长春高新	29,618.40	0.21	重大事项
2	600879	航天电子	27,126.90	0.19	重大事项

### 5.11.6 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## §6 开放式基金份额变动

转型后：

单位：份

基金合同生效日（2016年4月25日）基金份额总额	11,007,264.31
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	706,959.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	10,300,305.10

转型前：

单位：份

报告期期初基金份额总额	11,268,918.81
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	261,654.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	11,007,264.31

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

注：本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

注：本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 4 月 25 日披露了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，自公告之日起，《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效，同时《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

金基金合同》生效，基金名称变更为“银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金募集的文件以及银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型事项的持有人大会决议向中国证监会备案的文件

9.1.2 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

9.1.3 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.4 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

9.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 9.2 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。

### 9.3 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理有限公司  
2016 年 7 月 19 日