

# 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 年半年度报告

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

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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 8 月 22 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 1 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）。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况（转型前）.....                         | 5         |
| 2.1 基金基本情况（转型后）.....                         | 5         |
| 2.2 基金产品说明（转型前）.....                         | 5         |
| 2.2 基金产品说明（转型后）.....                         | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现（转型前）.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现（转型后）.....                         | 9         |
| 3.3 其他指标.....                                | 错误！未定义书签。 |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 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.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16        |
| 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.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....         | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表(转型前).....                          | 17        |
| 6.2 利润表.....                                 | 18        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 19        |
| 6.4 报表附注.....                                | 20        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....         | <b>38</b> |
| 6.1 资产负债表（转型后）.....                          | 38        |
| 6.2 利润表.....                                 | 39        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 40        |
| 6.4 报表附注.....                                | 41        |
| <b>§7 投资组合报告(转型前)</b> .....                  | <b>61</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 61        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 62        |

|  |            |
|--|------------|
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....      | 62         |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                    | 74         |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 75         |
| 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 .....     | 75         |
| 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 .....  | 75         |
| 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 .....  | 75         |
| 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 .....     | 75         |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 75         |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 76         |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                          | 76         |
| <b>§7 投资组合报告(转型后) .....</b>                  | <b>77</b>  |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                         | 77         |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                     | 77         |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后) ..... | 78         |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                    | 85         |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 86         |
| 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 .....     | 87         |
| 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 .....  | 87         |
| 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 .....  | 87         |
| 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 .....     | 87         |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 87         |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 87         |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                          | 88         |
| <b>§8 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>               | <b>88</b>  |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 88         |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                       | 错误! 未定义书签。 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 89         |
| 8.4 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 .....      | 89         |
| <b>§8 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>               | <b>89</b>  |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 89         |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                       | 错误! 未定义书签。 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 89         |
| 8.4 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 .....      | 89         |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                    | <b>90</b>  |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                      | <b>90</b>  |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                       | 90         |
| 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 .....       | 91         |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 91         |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                         | 91         |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 91         |
| 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 .....          | 91         |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) .....           | 91         |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) .....           | 97         |
| 10.8 其他重大事件 (转型后) .....                      | 102        |
| 10.8 其他重大事件 (转型前) .....                      | 104        |

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 107 |
| §12 备查文件目录.....         | 107 |
| 12.1 备查文件目录.....        | 107 |
| 12.2 存放地点.....          | 107 |
| 12.3 查阅方式.....          | 108 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|             |                             |
|-------------|-----------------------------|
| 基金名称        | 银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 |
| 基金简称        | 银华成长股债 30/70 指数             |
| 基金主代码       | 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             |
| 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  | 11,007,264.31 份             |
| 基金合同存续期（若有） | 不定期                         |

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|             |                       |
|-------------|-----------------------|
| 基金名称        | 银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称        | 银华量化智慧动力灵活配置混合        |
| 基金主代码       | 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       |
| 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  | 10,300,305.10 份       |
| 基金合同存续期（若有） | 不定期                   |

### 2.2 基金产品说明（转型前）

|      |  |
|------|--|
| 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。<br>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（若有） | 中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  |
| 风险收益特征（若有） | 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。 |

## 2.2 基金产品说明（转型后）

|            |  |
|------------|--|
| 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（若有） | 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（若有） | 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。   |

## 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                  | tianqingl.zh@ccb.com        |
| 客户服务电话  |      | 4006783333, (010) 85186558          | (010) 67595096              |
| 传真      |      | (010) 58163027                      | (010) 66275853              |
| 注册地址    |      | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层        | 北京市西城区金融大街 25 号             |
| 办公地址    |      | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心 |
| 邮政编码    |      | 100738                              | 100033                      |
| 法定代表人   |      | 王珠林                                 | 王洪章                         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a> |
| 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   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                |
|--------|------------|-------------------------------------|
| 注册登记机构 | 银华基金管理有限公司 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层 |

## § 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 | 报告期(2016年1月1日-2016年6月30日) |                            |
|---------------|---------------------------|----------------------------|
|               | 转型前(2016年1月1日至2016年4月24日) | 转型后(2016年4月25日至2016年6月30日) |
| 本期已实现收益       | -70,771.86                | -175,112.40                |
| 本期利润          | -963,655.08               | -202,179.26                |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0818                   | -0.0189                    |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.43%                    | -1.50%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | -5.93%                    | -1.58%                     |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末                 |                      |
|---------------|----------------------|----------------------|
|               | 转型前（2016 年 4 月 24 日） | 转型后（2016 年 6 月 30 日） |
| 期末可供分配利润      | 2,956,206.26         | -388,015.71          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2686               | -0.0377              |
| 期末基金资产净值      | 13,963,470.57        | 12,868,495.65        |
| 期末基金份额净值      | 1.269                | 1.249                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末                 |                      |
|               | 转型前（2016 年 4 月 24 日） | 转型后（2016 年 6 月 30 日） |
| 基金份额累计净值增长率   | 26.90%               | -1.58%               |

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。

4、本基金于 2016 年 4 月 25 日成立，主要财务指标的实际计算期间为 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

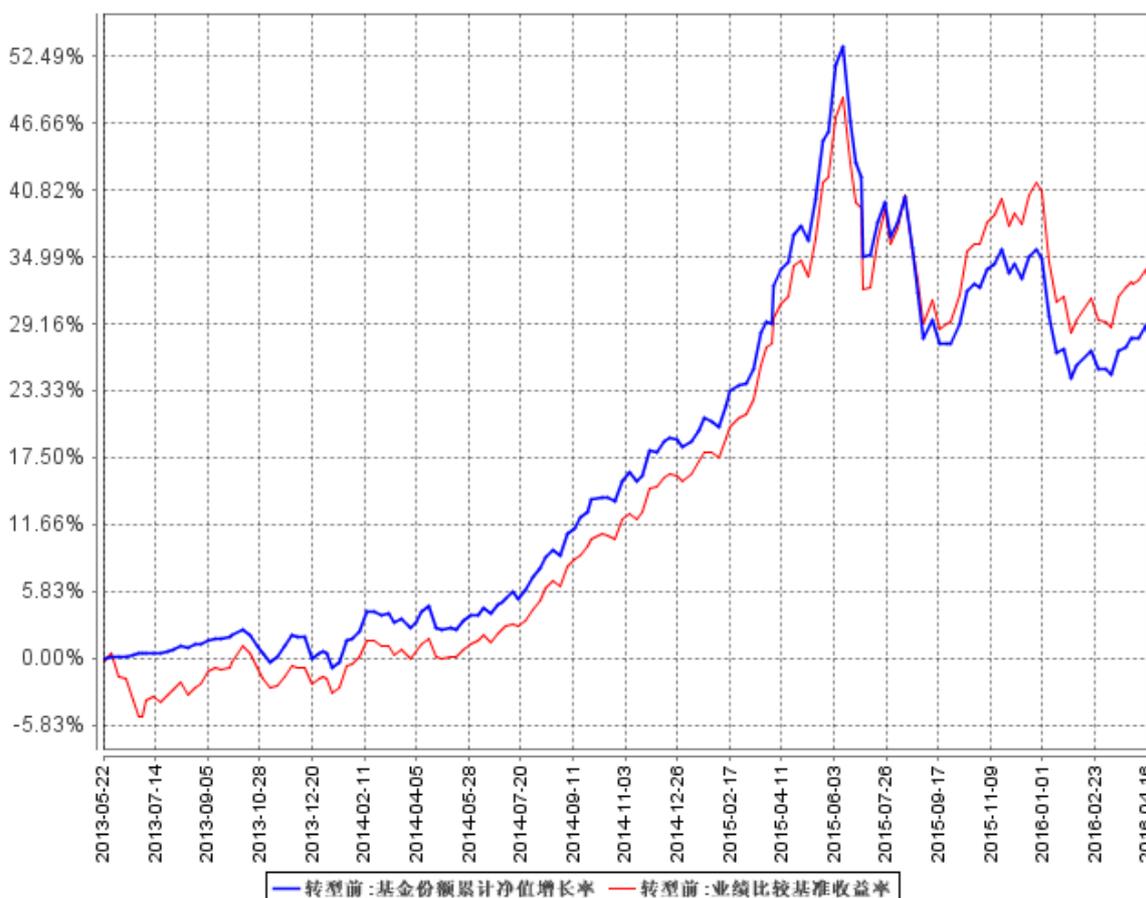
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 转型前                                  |          |             |            |               |        |        |
|--------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 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    |
| 2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 4 月 24 日   | -5.93%   | 0.68%       | -6.51%     | 0.80%         | 0.58%  | -0.12% |
| 2016 年 3 月 25 日至<br>2016 年 4 月 24 日  | -0.16%   | 0.40%       | -0.39%     | 0.48%         | 0.23%  | -0.08% |
| 2016 年 1 月 25 日至<br>2016 年 4 月 24 日  | -0.08%   | 0.56%       | -0.01%     | 0.66%         | -0.07% | -0.10% |
| 2015 年 10 月 25 日至<br>2016 年 4 月 24 日 | -4.30%   | 0.61%       | -3.42%     | 0.71%         | -0.88% | -0.10% |
| 2015 年 4 月 25 日至<br>2016 年 4 月 24 日  | -7.30%   | 0.81%       | -1.98%     | 0.88%         | -5.32% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至<br>2016 年 4 月 24 日         | 26.90%   | 0.56%       | 31.51%     | 0.62%         | -4.61% | -0.06% |

注：本基金业绩比较基准为：中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。由于本基金的标的指数是中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数，且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%。因此，本基金将业绩比较基准定为中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

### 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



注：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%。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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

| 转型后        |          |             |            |               |        |        |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 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      | -2.42%   | 0.72%       | 0.66%      | 0.57%         | -3.08% | 0.15%  |
| 自基金合同生效起至今 | -1.58%   | 0.56%       | 0.63%      | 0.59%         | -2.21% | -0.03% |

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 800 只 A 股作为样本的

综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场上大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，其选样是所有流通的符合指数设计原则的记帐式国债、央行票据和政策性银行债，是综合反映境内利率类债券整体价格走势情况的债券指数。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

### 3.2.2 自基金转型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



注：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%。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 62 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、银华永益分级债券型证券投资基金和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、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。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（转型前）

| 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  | 本基金的     | 2014 年          | 2016 年 4 月      | 6 年    | 博士学位。2008 年至 2011 年  |

|   |      |          |      |  |   |
|---|------|----------|------|--|---|
| 生 | 基金经理 | 10 月 8 日 | 25 日 |  | 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之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。

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

| 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 |        |   |
| 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 1 月 14 日起兼任银华全球核心优选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之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合规守信情况的说明

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 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

本基金使用大数据分析技术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 月中旬建仓的过程中，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，力争为持有人提供正收益。

### 4.4.2 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 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日）份额净值增长率为-5.93%，同期业绩比较基准收益率为-6.51%。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。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的半年，A 股市场在一系列内部和外部事件的冲击下，出现较大的震荡。年初在美元进入加息周期、人民币大幅度波动、成长股业绩地雷频现、场内资金缩减等多重负面因素的影响之下，市场避险情绪空前强烈，股票市场也经历大幅度的下跌；但在春节前后，随着地产政策的进一步放松、多部委出台稳增长政策、货币政策持续宽松、供给侧改革稳步推进，投资者的信心逐步恢复，股票市场开始逐步企稳反弹。然而在二季度初随着权威人士讲话对大幅度经济刺激的否定及一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，一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、英国脱欧等一系列事件，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，随着英国脱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。

## 4.6 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验。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（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 1 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 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关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 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

### 6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：银华中证成长股债恒定组合 3070 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 4 月 24 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 报告期初至转型前        | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|-----------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                 |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 517,223.94      | 682,877.99                       |
| 结算备付金           |            | 110,879.64      | 82,030.52                        |
| 存出保证金           |            | 230.85          | 3,057.83                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 15,010,947.95   | 15,933,155.44                    |
| 其中：股票投资         |            | 3,204,597.95    | 4,100,705.44                     |
| 基金投资            |            | -               | -                                |
| 债券投资            |            | 11,806,350.00   | 11,832,450.00                    |
| 资产支持证券投资        |            | -               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -               | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 3,928.48        | 200,000.00                       |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 147,227.36      | 295,731.50                       |
| 应收股利            |            | -               | -                                |
| 应收申购款           |            | -               | 19,565.96                        |
| 递延所得税资产         |            | -               | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -               | -                                |
| 资产总计            |            | 15,790,438.22   | 17,216,419.24                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>报告期初至转型前</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                 |                                  |
| 短期借款            |            | -               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -               | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款     |          | 1,600,000.00  | 700,000.00    |
| 应付证券清算款       |          | 64.12         | -             |
| 应付赎回款         |          | 2,765.94      | 297,930.84    |
| 应付管理人报酬       |          | 5,589.39      | 8,196.63      |
| 应付托管费         |          | 1,863.14      | 2,732.18      |
| 应付销售服务费       |          | -             | -             |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | -             | 353.09        |
| 应交税费          |          | -             | -             |
| 应付利息          |          | 87.69         | 120.60        |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 216,597.37    | 397,524.29    |
| 负债合计          |          | 1,826,967.65  | 1,406,857.63  |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 11,007,264.31 | 11,717,799.09 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 2,956,206.26  | 4,091,762.52  |
| 所有者权益合计       |          | 13,963,470.57 | 15,809,561.61 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 15,790,438.22 | 17,216,419.24 |

注：1、报告截止日 2016 年 4 月 24 日，基金份额净值为人民币 1.269 元，基金份额总额 11,007,264.31 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证成长股债恒定组合 3070 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 4 月 24 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>       |          | -727,408.12                              | 5,977,226.27                                  |
| 1. 利息收入           |          | 125,834.90                               | 679,996.93                                    |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 2,536.16                                 | 20,930.33                                     |
| 债券利息收入            |          | 121,995.62                               | 637,517.90                                    |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | 1,303.12                                 | 21,548.70                                     |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 19,068.77                                | 4,744,953.76                                  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | 17,660.65                                | 4,704,961.63                                  |
| 基金投资收益            |          | -  | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.13 | -  | 12,450.30                                     |

|                            |            |             |              |
|----------------------------|------------|-------------|--------------|
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13.5 | -           | -            |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14   | -           | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -           | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 1,408.12    | 27,541.83    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | -892,883.22 | 456,325.20   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -           | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.18   | 20,571.43   | 95,950.38    |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 236,246.96  | 622,607.10   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 28,349.62   | 91,599.13    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 9,449.92    | 30,532.98    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -           | -            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 94.92       | 31,841.18    |
| 5. 利息支出                    |            | 7,655.54    | 173,658.89   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 7,655.54    | 173,658.89   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 190,696.96  | 294,974.92   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -963,655.08 | 5,354,619.17 |
| 减：所得税费用                    |            | -           | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -963,655.08 | 5,354,619.17 |

注：本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证成长股债恒定组合 3070 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 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）                   | 11,717,799.09                         | 4,091,762.52  | 15,809,561.61  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | -963,655.08   | -963,655.08    |
| 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） | -710,534.78                           | -171,901.18   | -882,435.96    |
| 其中：1. 基金申购款                       | 12,855,743.66                         | 3,481,991.09  | 16,337,734.75  |
| 2. 基金赎回款                          | -13,566,278.44                        | -3,653,892.27 | -17,220,170.71 |

|  |                                 |                |                |
|--|---------------------------------|----------------|----------------|
| 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）                        | 11,007,264.31                   | 2,956,206.26   | 13,963,470.57  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015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）                        | 23,616,993.74                   | 4,342,238.60   | 27,959,232.34  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 5,354,619.17   | 5,354,619.17   |
| 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）      | -6,487,303.91                   | -2,509,523.59  | -8,996,827.50  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 57,166,611.80                   | 15,888,850.05  | 73,055,461.85  |
| 2. 基金赎回款                               | -63,653,915.71                  | -18,398,373.64 | -82,052,289.35 |
| 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）                        | 17,129,689.83                   | 7,187,334.18   | 24,317,024.01  |

注：本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止期间。

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：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>王立新</u> | <u>杨清</u> | <u>龚飒</u> |
| 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 基金基本情况

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金（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[2013]9 号《关于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批复》的核准，由银华基金管理有限公司于 2013 年 4 月 10 日至 2013 年 5 月 17 日向社会公开募集，基金合同于 2013 年 5 月 22 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 339,070,719.93 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数的成份证券及其备选成份证券（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（首次公开发行或增发）、债券回购、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并且无需召开基金份额持有人大会。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%。本基金的投资比较基准：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）  $\times 5\%$ 。

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”。

#### 6.4.2 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 3 号《半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。

#### 6.4.3 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 2016 年 4 月 24 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止。

#### 6.4.4.2 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (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、国家税务总局财税字[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。

##### (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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[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。

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

### (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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 517, 223. 94           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 517, 223. 94           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 3,179,062.98           | 3,204,597.95  | 25,534.97     |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 11,778,522.00 | 11,806,350.00 |
|               | 银行间市场                  | -             | -             |
|               | 合计                     | 11,778,522.00 | 11,806,350.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -             | -             |
| 基金            | -                      | -             | -             |
| 其他            | -                      | -             | -             |
| 合计            | 14,957,584.98          | 15,010,947.95 | 53,362.97     |

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,367.84               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 156.35                 |
| 应收债券利息     | 145,673.43             |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 29.54                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 0.20                   |
| 合计         | 147,227.36             |

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 应付交易费用

注：本基金于本报告期末无应付交易费用。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 10.41                  |
| 预提费用        | 153,400.15             |
| 指数使用费       | 63,186.81              |
| 合计          | 216,597.37             |

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 11,717,799.09                         | 11,717,799.09  |
| 本期申购          | 12,855,743.66                         | 12,855,743.66  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -13,566,278.44                        | -13,566,278.44 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 11,007,264.31                         | 11,007,264.31  |

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 5,391,422.39  | -1,299,659.87 | 4,091,762.52  |
| 本期利润           | -             | -963,655.08   | -963,655.08   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -317,435.89   | 145,534.71    | -171,901.18   |
| 其中：基金申购款       | 5,869,321.77  | -2,387,330.68 | 3,481,991.09  |
| 基金赎回款          | -6,186,757.66 | 2,532,865.39  | -3,653,892.27 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 5,073,986.50  | -2,117,780.24 | 2,956,206.26  |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,238.66                              |

|           |          |
|-----------|----------|
| 定期存款利息收入  | -        |
| 其他存款利息收入  | -        |
| 结算备付金利息收入 | 295.28   |
| 其他        | 2.22     |
| 合计        | 2,536.16 |

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2016年1月1日至2016年4月24日 |
| 卖出股票成交总额   | 46,984.92            |
| 减：卖出股票成本总额 | 29,324.27            |
| 买卖股票差价收入   | 17,660.65            |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                   |
|-------------|----------------------|
|             | 2016年1月1日至2016年4月24日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,408.12             |
| 基金投资产生的股利收益 | -                    |
| 合计          | 1,408.12             |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

|            | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |
|------------|---------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -892,883.22                     |
| ——股票投资     | -866,783.22                     |
| ——债券投资     | -26,100.00                      |
| ——资产支持证券投资 | -                               |
| ——贵金属投资    | -                               |
| ——其他       | -                               |
| 2. 衍生工具    | -                               |
| ——权证投资     | -                               |
| 3. 其他      | -                               |
| 合计         | -892,883.22                     |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 19,869.89                             |
| 转换费     | 701.54                                |
| 合计      | 20,571.43                             |

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 94.92                                 |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 94.92                                 |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 14,139.25                             |
| 信息披露费 | 94,260.90                             |
| 银行费用  | 310.00                                |
| 指数使用费 | 63,186.81                             |
| 账户维护费 | 18,800.00                             |
| 合计    | 190,696.96                            |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化的情况。

### 6.4.9.2 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 |

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年4月24日 |                      | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 |
| 西南证券  | -                          | -                    | 1,896,966.31                    | 10.27%               |
| 第一创业  | -                          | -                    | 1,580,333.32                    | 8.56%                |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金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。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年4月24日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|
|-------|----------------------------|---------------------------------|

|      | 回购成交金额 | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额        | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 |
|------|--------|----------------------------|---------------|----------------------------|
| 东北证券 | -      | -                          | 7,000,000.00  | 2.23%                      |
| 西南证券 | -      | -                          | 14,000,000.00 | 4.47%                      |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金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权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年4月24日      |                |          |                      |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付<br>佣金总额的<br>比例 |
| 东北证券  | -                               | -              | -        | -                    |
| 西南证券  | -                               | -              | -        | -                    |
| 第一创业  | -                               | -              | -        | -                    |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                |          |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付<br>佣金总额的<br>比例 |
| 东北证券  | -                               | -              | -        | -                    |
| 西南证券  | 1,726.95                        | 10.27%         | 1,726.95 | 18.50%               |
| 第一创业  | 1,438.99                        | 8.56%          | -        | -                    |

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   | 上年度可比期间              |
|------------------------------|----------------------|----------------------|
|                              | 2016年1月1日至2016年4月24日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费               | 28,349.62            | 91,599.13            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup> | 8,327.50             | 27,652.22            |

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 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,449.92                        | 30,532.98                       |

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金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。

#### 6.4.10.5 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                              |          | 上年度可比期间                         |           |
|--------|---------------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|        | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 |          | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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 | 517,223.94                      | 2,238.66 | 8,923,854.95                    | 18,390.26 |

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016 年 4 月 24 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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新发/增发而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

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 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 000661 | 长春高新 | 2016 年 4 月 19 日  | 重大事项 | 103.20 | 2016 年 4 月 27 日 | 91.20  | 287   | 36,197.43 | 29,618.40 | -  |
| 600879 | 航天电子 | 2016 年 4 月 15 日  | 重大事项 | 15.30  | 2016 年 4 月 28 日 | 14.50  | 1,773 | 19,287.06 | 27,126.90 | -  |
| 600654 | 中安消  | 2016 年 4 月 22 日  | 重大事项 | 24.53  | 2016 年 4 月 25 日 | 24.86  | 964   | 8,117.37  | 23,646.92 | -  |
| 600122 | 宏图高科 | 2015 年 12 月 25 日 | 重大事项 | 14.95  | 2016 年 6 月 14 日 | 17.44  | 1,000 | 4,991.73  | 14,950.00 | -  |
| 002405 | 四维图新 | 2016 年 3 月 16 日  | 重大事项 | 28.82  | 2016 年 5 月 30 日 | 19.39  | 444   | 8,129.40  | 12,796.08 | -  |
| 600219 | 南山铝业 | 2016 年 4 月 18 日  | 重大事项 | 7.46   | 2016 年 5 月 6 日  | 7.60   | 1,544 | 14,592.60 | 11,518.24 | -  |
| 002573 | 清新环境 | 2016 年 1 月 4 日   | 重大事项 | 22.44  | 2016 年 5 月 30 日 | 20.10  | 508   | 7,947.62  | 11,399.52 | -  |

|        |      |                  |      |       |                 |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------------|------|-------|-----------------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 600584 | 长电科技 | 2015 年 11 月 30 日 | 重大事项 | 18.12 | 2016 年 5 月 10 日 | 19.81 | 607 | 5,122.64  | 10,998.84 | - |
| 600770 | 综艺股份 | 2016 年 1 月 7 日   | 重大事项 | 16.56 | 2016 年 5 月 4 日  | 16.00 | 576 | 4,990.80  | 9,538.56  | - |
| 600522 | 中天科技 | 2016 年 4 月 8 日   | 重大事项 | 19.10 | 2016 年 4 月 25 日 | 8.26  | 467 | 6,284.08  | 8,919.70  | - |
| 603188 | 亚邦股份 | 2016 年 2 月 22 日  | 重大事项 | 16.75 | 2016 年 4 月 29 日 | 16.50 | 519 | 16,202.14 | 8,693.25  | - |
| 002219 | 恒康医疗 | 2015 年 7 月 8 日   | 重大事项 | 14.90 | 2016 年 6 月 22 日 | 13.41 | 568 | 3,953.22  | 8,463.20  | - |
| 600487 | 亨通光电 | 2016 年 4 月 11 日  | 重大事项 | 11.95 | 2016 年 4 月 25 日 | 11.95 | 705 | 4,769.85  | 8,424.75  | - |
| 000997 | 新大陆  | 2016 年 3 月 3 日   | 重大事项 | 16.97 | 2016 年 6 月 3 日  | 18.59 | 490 | 5,796.17  | 8,315.30  | - |
| 000718 | 苏宁环球 | 2016 年 1 月 4 日   | 重大事项 | 10.18 | 2016 年 7 月 18 日 | 11.78 | 789 | 3,853.88  | 8,032.02  | - |
| 000547 | 航天发展 | 2016 年 4 月 19 日  | 重大事项 | 15.40 | -               | -     | 509 | 18,522.51 | 7,838.60  | - |
| 600511 | 国药股份 | 2016 年 2 月 18 日  | 重大事项 | 27.52 | 2016 年 8 月 4 日  | 30.16 | 212 | 3,821.24  | 5,834.24  | - |
| 300043 | 互动娱乐 | 2015 年 12 月 17 日 | 重大事项 | 15.80 | 2016 年 6 月 20 日 | 14.22 | 354 | 7,366.74  | 5,593.20  | - |
| 002190 | 成飞集成 | 2016 年 4 月 21 日  | 重大事项 | 35.54 | 2016 年 7 月 12 日 | 38.98 | 153 | 9,414.60  | 5,437.62  | - |
| 000975 | 银泰资源 | 2016 年 4 月 19 日  | 重大事项 | 15.00 | -               | -     | 317 | 3,466.24  | 4,755.00  | - |

|        |      |             |      |       |            |       |     |          |          |   |
|--------|------|-------------|------|-------|------------|-------|-----|----------|----------|---|
| 000612 | 焦作万方 | 2016年2月29日  | 重大事项 | 5.94  | 2016年6月27日 | 5.99  | 772 | 7,645.94 | 4,585.68 | - |
| 600260 | 凯乐科技 | 2016年4月20日  | 重大事项 | 12.49 | 2016年5月4日  | 12.90 | 360 | 3,486.30 | 4,496.40 | - |
| 600120 | 浙江东方 | 2015年10月12日 | 重大事项 | 19.86 | 2016年6月30日 | 21.71 | 225 | 3,672.67 | 4,468.50 | - |
| 000401 | 冀东水泥 | 2016年4月6日   | 重大事项 | 10.90 | 2016年7月14日 | 11.32 | 403 | 7,726.01 | 4,392.70 | - |
| 000693 | 华泽钴镍 | 2016年3月1日   | 重大事项 | 12.50 | -          | -     | 332 | 8,363.53 | 4,150.00 | - |
| 000636 | 风华高科 | 2016年3月15日  | 重大事项 | 8.87  | 2016年7月13日 | 9.72  | 421 | 2,492.27 | 3,734.27 | - |
| 600006 | 东风汽车 | 2016年2月22日  | 重大事项 | 6.21  | 2016年4月29日 | 6.79  | 590 | 2,408.52 | 3,663.90 | - |
| 000603 | 盛达矿业 | 2016年4月21日  | 重大事项 | 19.58 | 2016年4月28日 | 18.78 | 180 | 4,550.02 | 3,524.40 | - |
| 601001 | 大同煤业 | 2016年2月26日  | 重大事项 | 5.44  | 2016年6月8日  | 4.99  | 624 | 5,197.87 | 3,394.56 | - |
| 002293 | 罗莱生活 | 2016年4月13日  | 重大事项 | 14.40 | 2016年5月5日  | 14.77 | 214 | 1,952.20 | 3,081.60 | - |
| 600864 | 哈投股份 | 2016年4月21日  | 重大事项 | 12.70 | 2016年4月29日 | 12.12 | 242 | 2,513.94 | 3,073.40 | - |
| 600329 | 中新药业 | 2016年4月22日  | 重大事项 | 17.12 | 2016年4月27日 | 17.05 | 157 | 2,196.92 | 2,687.84 | - |
| 600640 | 号百控股 | 2016年4月18日  | 重大事项 | 16.79 | -          | -     | 157 | 3,059.53 | 2,636.03 | - |

|        |          |                    |          |       |                    |       |     |          |          |   |
|--------|----------|--------------------|----------|-------|--------------------|-------|-----|----------|----------|---|
| 600468 | 百利电<br>气 | 2016 年 2<br>月 2 日  | 重大事<br>项 | 11.47 | 2016 年 5<br>月 19 日 | 12.61 | 134 | 1,508.53 | 1,536.98 | - |
| 000582 | 北部湾<br>港 | 2016 年 2<br>月 29 日 | 重大事<br>项 | 16.38 | -                  | -     | 53  | 1,595.83 | 868.14   | - |

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基本资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性较小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃

而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 | 1 个月以内       | 1-3 个月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年        | 5 年以上 | 不计息          | 合计            |
|------------------------|--------------|--------|--------------|--------------|-------|--------------|---------------|
| 资产                     |              |        |              |              |       |              |               |
| 银行存款                   | 517,223.94   | -      | -            | -            | -     | -            | 517,223.94    |
| 结算备付金                  | 110,879.64   | -      | -            | -            | -     | -            | 110,879.64    |
| 存出保证金                  | 230.85       | -      | -            | -            | -     | -            | 230.85        |
| 交易性金融资产                | -            | -      | 5,499,450.00 | 6,306,900.00 | -     | 3,204,597.95 | 15,010,947.95 |
| 应收证券清算款                | -            | -      | -            | -            | -     | 3,928.48     | 3,928.48      |
| 应收利息                   | -            | -      | -            | -            | -     | 147,227.36   | 147,227.36    |
| 其他资产                   | -            | -      | -            | -            | -     | -            | -             |
| 资产总计                   | 628,334.43   | -      | 5,499,450.00 | 6,306,900.00 | -     | 3,355,753.79 | 15,790,438.22 |
| 负债                     |              |        |              |              |       |              |               |
| 卖出回购金融资产款              | 1,600,000.00 | -      | -            | -            | -     | -            | 1,600,000.00  |
| 应付证券清算款                | -            | -      | -            | -            | -     | 64.12        | 64.12         |
| 应付赎回款                  | -            | -      | -            | -            | -     | 2,765.94     | 2,765.94      |

|                     |              |       |               |              |      |               |               |
|---------------------|--------------|-------|---------------|--------------|------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -             | -            | -    | 5,589.39      | 5,589.39      |
| 应付托管费               | -            | -     | -             | -            | -    | 1,863.14      | 1,863.14      |
| 应付利息                | -            | -     | -             | -            | -    | 87.69         | 87.69         |
| 其他负债                | -            | -     | -             | -            | -    | 216,597.37    | 216,597.37    |
| 负债总计                | 1,600,000.00 | -     | -             | -            | -    | 226,967.65    | 1,826,967.65  |
| 利率敏感度缺口             | -971,665.57  | -     | -5,499,450.00 | 6,306,900.00 | -    | -3,128,786.14 | 13,963,470.57 |
| 上年度末<br>2015年12月31日 | 1个月以内        | 1-3个月 | 3个月-1年        | 1-5年         | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                  |              |       |               |              |      |               |               |
| 银行存款                | 682,877.99   | -     | -             | -            | -    | -             | 682,877.99    |
| 结算备付金               | 82,030.52    | -     | -             | -            | -    | -             | 82,030.52     |
| 存出保证金               | 3,057.83     | -     | -             | -            | -    | -             | 3,057.83      |
| 交易性金融资产             | -            | -     | -5,496,150.00 | 6,336,300.00 | -    | -4,100,705.44 | 15,933,155.44 |
| 应收证券清算款             | -            | -     | -             | -            | -    | 200,000.00    | 200,000.00    |
| 应收利息                | -            | -     | -             | -            | -    | 295,731.50    | 295,731.50    |
| 应收申购款               | -            | -     | -             | -            | -    | 19,565.96     | 19,565.96     |
| 其他资产                | -            | -     | -             | -            | -    | -             | -             |
| 资产总计                | 767,966.34   | -     | -5,496,150.00 | 6,336,300.00 | -    | -4,616,002.90 | 17,216,419.24 |
| 负债                  |              |       |               |              |      |               |               |
| 卖出回购金融资产款           | 700,000.00   | -     | -             | -            | -    | -             | 700,000.00    |
| 应付赎回款               | -            | -     | -             | -            | -    | 297,930.84    | 297,930.84    |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -             | -            | -    | 8,196.63      | 8,196.63      |
| 应付托管费               | -            | -     | -             | -            | -    | 2,732.18      | 2,732.18      |
| 应付交易费用              | -            | -     | -             | -            | -    | 353.09        | 353.09        |
| 应付利息                | -            | -     | -             | -            | -    | 120.60        | 120.60        |
| 其他负债                | -            | -     | -             | -            | -    | 397,524.29    | 397,524.29    |
| 负债总计                | 700,000.00   | -     | -             | -            | -    | 706,857.63    | 1,406,857.63  |
| 利率敏感度缺口             | 67,966.34    | -     | -5,496,150.00 | 6,336,300.00 | -    | -3,909,145.27 | 15,809,561.61 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|         |                                  |                             |                   |
|---------|----------------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设      | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                             |                   |
|         | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                             |                   |
|         | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                             |                   |
| 分析      | 相关风险变量的变动                        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|         |                                  | 本期末（2016年4月24日）             | 上年度末（2015年12月31日） |
|         | +25个基准点                          | -38,785.75                  | -47,584.14        |
| -25个基准点 | 38,785.75                        | 47,584.14                   |                   |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，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%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 4 月 24 日 |               | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 3,204,597.95           | 22.95         | 4,100,705.44             | 25.94         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 11,806,350.00          | 84.55         | 11,832,450.00            | 74.84         |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —             | —                        | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —             | —                        | —             |
| 其他            | —                      | —             | —                        | —             |
| 合计            | 15,010,947.95          | 107.50        | 15,933,155.44            | 100.78        |

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |  |
|----|--|--|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；                        |  |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；             |  |
|    | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 |  |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）            |
|    |  | 本期末（2016 年 4 月）      上年度末（2015 年 12 月） |

|  |     |             |               |
|--|-----|-------------|---------------|
|  |     | 24 日)       | 31 日)         |
|  | +5% | 623,844.44  | 1,126,386.30  |
|  | -5% | -623,844.44 | -1,126,386.30 |

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

### 6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 转型后至报告期末        |
|-----------------|------------|-----------------|
| <b>资产：</b>      |            |                 |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,105,655.06    |
| 结算备付金           |            | 97,425.30       |
| 存出保证金           |            | 2,969.27        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 5,000,063.31    |
| 其中：股票投资         |            | 3,481,013.31    |
| 基金投资            |            | -               |
| 债券投资            |            | 1,519,050.00    |
| 资产支持证券投资        |            | -               |
| 贵金属投资           |            | -               |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -               |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -               |
| 应收证券清算款         |            | 7,001,477.78    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 13,955.19       |
| 应收股利            |            | -               |
| 应收申购款           |            | -               |
| 递延所得税资产         |            | -               |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -               |
| 资产总计            |            | 13,221,545.91   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>转型后至报告期末</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                 |
| 短期借款            |            | -               |

|               |          |               |
|---------------|----------|---------------|
| 交易性金融负债       |          | -             |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -             |
| 卖出回购金融资产款     |          | -             |
| 应付证券清算款       |          | 6.00          |
| 应付赎回款         |          | 65,773.70     |
| 应付管理人报酬       |          | 16,289.31     |
| 应付托管费         |          | 2,714.89      |
| 应付销售服务费       |          | -             |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 33,418.94     |
| 应交税费          |          | -             |
| 应付利息          |          | -             |
| 应付利润          |          | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 234,847.42    |
| 负债合计          |          | 353,050.26    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 10,300,305.10 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 2,568,190.55  |
| 所有者权益合计       |          | 12,868,495.65 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 13,221,545.91 |

注：1. 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.249 元，基金份额总额为 10,300,305.10 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期                               |
|-------------------|----------|----------------------------------|
|                   |          | 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 一、收入              |          | -39,100.17                       |
| 1. 利息收入           |          | 31,786.00                        |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 6,322.53                         |
| 债券利息收入            |          | 20,783.96                        |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                |
| 买入返售金融资产收入        |          | 4,679.51                         |
| 其他利息收入            |          | -                                |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | -44,636.33                       |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | -77,156.79                       |
| 基金投资收益            |          | -                                |
| 债券投资收益            | 6.4.7.13 | 13,088.60                        |

|                            |            |             |
|----------------------------|------------|-------------|
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13.5 | -           |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14   | -           |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -           |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 19,431.86   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | -27,066.86  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -           |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.18   | 817.02      |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 163,079.09  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 37,114.54   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 6,185.74    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -           |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 55,208.59   |
| 5. 利息支出                    |            | 90.82       |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 90.82       |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 64,479.40   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -202,179.26 |
| 减：所得税费用                    |            | -           |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -202,179.26 |

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016 年 4 月 25 日至 2016 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)                   | 11,007,264.31                          | 2,956,206.26 | 13,963,470.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | -202,179.26  | -202,179.26   |
| 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） | -706,959.21                            | -185,836.45  | -892,795.66   |
| 其中：1. 基金申购款                       | -                                      | -            | -             |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                 | -706,959.21                            | -185,836.45  | -892,795.66   |

|  |               |              |               |
|--|---------------|--------------|---------------|
| 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)                        | 10,300,305.10 | 2,568,190.55 | 12,868,495.65 |

注：本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止。

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：

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| <u>王立新</u> | <u>杨清</u> | <u>龚飒</u> |
| 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 基金基本情况

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金由银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型而来。

基金管理人已于 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》同时生效。

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（包括中小板股票、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转换债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的投资比较基准：中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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为 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本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。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第 1 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 2 层次：输入值是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 3 层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1. 股票投资

##### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的

收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

## (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值。

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

## 2. 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。估值日无交易的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影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大

变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

### 3. 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

### 4. 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中的相关原则进行估值。

### 5. 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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转换所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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交

易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投方式免收再投资的费用；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；
- (2) 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，暂不缴纳企业所得税；
- (3) 对基金所持上市公司股票，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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，2015 年 9 月 8 日之前其股息红利所得暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；
- (4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；
- (5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；
- (6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|    |                        |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 活期存款           | 1,105,655.06 |
| 定期存款           | -            |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -            |
| 其他存款           | -            |
| 合计：            | 1,105,655.06 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |              |           |
|-------------------|------------------------|--------------|-----------|
|                   | 成本                     | 公允价值         | 估值增值      |
| 股票                | 3,455,017.20           | 3,481,013.31 | 25,996.11 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -            | -         |
| 债券                | 交易所市场                  | 1,518,750.00 | 300.00    |
|                   | 银行间市场                  | -            | -         |
|                   | 合计                     | 1,518,750.00 | 300.00    |
| 资产支持证券            | -                      | -            | -         |
| 基金                | -                      | -            | -         |
| 其他                | -                      | -            | -         |
| 合计                | 4,973,767.20           | 5,000,063.31 | 26,296.11 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,044.56               |
| 应收定期存款利息 | -                      |
| 应收其他存款利息 | -                      |

|            |           |
|------------|-----------|
| 应收结算备付金利息  | 43.80     |
| 应收债券利息     | 12,835.89 |
| 应收买入返售证券利息 | -         |
| 应收申购款利息    | 29.54     |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -         |
| 其他         | 1.40      |
| 合计         | 13,955.19 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 33,418.94         |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 33,418.94         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 105.59            |
| 预提费用        | 171,555.02        |
| 指数使用费       | 63,186.81         |
| 合计          | 234,847.42        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |               |
|-------------------|-----------------------------|---------------|
|                   | 基金份额（份）                     | 账面金额          |
| 基金合同生效日           | 11,007,264.31               | 11,007,264.31 |
| - 基金份额折算调整        | -                           | -             |
| - 未领取红利份额折算调整（若有） | -                           | -             |
| - 集中申购募集资金本金及利息   | -                           | -             |

|                |               |               |
|----------------|---------------|---------------|
| - 基金拆分和集中申购完成后 | -             | -             |
| 本期申购           | -             | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列）  | -706,959.21   | -706,959.21   |
| 本期末            | 10,300,305.10 | 10,300,305.10 |

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|---------------|--------------|
| 基金合同生效日        | 5,073,986.50 | -2,117,780.24 | 2,956,206.26 |
| 本期利润           | -            | -202,179.26   | -202,179.26  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -318,409.12  | 132,572.67    | -185,836.45  |
| 其中：基金申购款       | -            | -             | -            |
| 基金赎回款          | -318,409.12  | 132,572.67    | -185,836.45  |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -            |
| 本期末            | 4,755,577.38 | -2,187,386.83 | 2,568,190.55 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

| 项目        | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|-----------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 6,047.84                    |
| 定期存款利息收入  | -                           |
| 其他存款利息收入  | -                           |
| 结算备付金利息收入 | 269.23                      |
| 其他        | 5.46                        |
| 合计        | 6,322.53                    |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|------------|-----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 18,470,284.60               |
| 减：卖出股票成本总额 | 18,547,441.39               |
| 买卖股票差价收入   | -77,156.79                  |

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|-------------------------------|-----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 13,088.60                   |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                           |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                           |
| 合计                            | 13,088.60                   |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|-------------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额   | 10,426,482.10               |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,259,772.00               |
| 减：应收利息总额                | 153,621.50                  |
| 买卖债券差价收入                | 13,088.60                   |

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止期间无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|-------------|-----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 19,431.86                   |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 19,431.86 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|------------|-----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -27,066.86                  |
| ——股票投资     | 461.14                      |
| ——债券投资     | -27,528.00                  |
| ——资产支持证券投资 | -                           |
| ——贵金属投资    | -                           |
| ——其他       | -                           |
| 2. 衍生工具    | -                           |
| ——权证投资     | -                           |
| 3. 其他      | -                           |
| 合计         | -27,066.86                  |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 531.46                      |
| 转换费     | 285.56                      |
| 合计      | 817.02                      |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|-----------|-----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 55,208.59                   |
| 银行间市场交易费用 | -                           |
| 合计        | 55,208.59                   |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2016年4月25日至2016年6月30日 |
|------|-----------------------------|
| 审计费用 | 8,237.65                    |

|       |           |
|-------|-----------|
| 信息披露费 | 54,917.22 |
| 银行费用  | 964.53    |
| 指数使用费 | -         |
| 账户维护费 | -         |
| 其他    | 360.00    |
| 合计    | 64,479.40 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化的情况。

### 6.4.9.2 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 |

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。

## 6.4.10 本报告期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未通过关联方席位进行交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|
| 当期应支付的管理费       | 37,114.54                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 15,902.15                              |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               |
|-----------|----------------------------------|
|           | 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 当期应支付的托管费 | 6,185.74                         |

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 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 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日未运用固有资金投资本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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                               |          |
|-------|----------------------------------|----------|
|       | 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 30 日 |          |
|       | 期末余额                             | 当期利息收入   |
| 建设银行  | 1,105,655.06                     | 6,047.84 |

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

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 |
|--------|--------|------------|------|--------|-----------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 000728 | 国元证券   | 2016年6月8日  | 重大事项 | 16.72  | 2016年7月8日 | 17.37  | 4,400 | 70,991.00 | 73,568.00 | -  |
| 300032 | 金龙机电   | 2016年6月28日 | 重大事项 | 20.10  | 2016年7月7日 | 19.80  | 1,200 | 23,352.00 | 24,120.00 | -  |
| 300111 | 向日葵    | 2016年6月14日 | 重大事项 | 4.90   | -         | -      | 4,800 | 24,352.00 | 23,520.00 | -  |
| 300052 | 中青宝    | 2016年6月8日  | 重大事项 | 22.03  | -         | -      | 800   | 17,136.00 | 17,624.00 | -  |
| 300166 | 东方国信   | 2016年6月8日  | 重大事项 | 27.47  | -         | -      | 600   | 15,600.00 | 16,482.00 | -  |
| 000511 | *ST 烯碳 | 2016年4月26日 | 重大事项 | 8.92   | -         | -      | 887   | 5,973.03  | 7,912.04  | -  |

|        |          |                |          |       |                |       |     |           |          |   |
|--------|----------|----------------|----------|-------|----------------|-------|-----|-----------|----------|---|
| 000718 | 苏宁环<br>球 | 2016年1<br>月4日  | 重大事<br>项 | 9.91  | 2016年7<br>月18日 | 11.78 | 789 | 3,853.88  | 7,818.99 | - |
| 000547 | 航天发<br>展 | 2016年4<br>月19日 | 重大事<br>项 | 15.36 | -              | -     | 509 | 18,522.51 | 7,818.24 | - |
| 002465 | 海格通<br>信 | 2016年6<br>月13日 | 重大事<br>项 | 12.44 | -              | -     | 600 | 7,056.00  | 7,464.00 | - |
| 600511 | 国药股<br>份 | 2016年2<br>月18日 | 重大事<br>项 | 27.42 | 2016年8<br>月4日  | 30.16 | 212 | 3,821.24  | 5,813.04 | - |
| 002190 | 成飞集<br>成 | 2016年4<br>月21日 | 重大事<br>项 | 35.44 | 2016年7<br>月12日 | 38.98 | 153 | 9,414.60  | 5,422.32 | - |
| 600614 | 鼎立股<br>份 | 2016年4<br>月26日 | 重大事<br>项 | 8.14  | -              | -     | 626 | 3,676.77  | 5,095.64 | - |
| 000975 | 银泰资<br>源 | 2016年4<br>月19日 | 重大事<br>项 | 15.00 | -              | -     | 317 | 3,466.24  | 4,755.00 | - |
| 000401 | 冀东水<br>泥 | 2016年4<br>月6日  | 重大事<br>项 | 10.90 | 2016年7<br>月14日 | 11.32 | 403 | 7,726.01  | 4,392.70 | - |
| 000693 | ST华泽     | 2016年3<br>月1日  | 重大事<br>项 | 12.50 | -              | -     | 332 | 8,363.53  | 4,150.00 | - |
| 000636 | 风华高<br>科 | 2016年3<br>月15日 | 重大事<br>项 | 8.84  | 2016年7<br>月13日 | 9.72  | 421 | 2,492.27  | 3,721.64 | - |
| 600640 | 号百控<br>股 | 2016年4<br>月18日 | 重大事<br>项 | 16.79 | -              | -     | 157 | 3,059.53  | 2,636.03 | - |
| 002663 | 普邦园<br>林 | 2016年4<br>月28日 | 重大事<br>项 | 7.36  | -              | -     | 136 | 807.93    | 1,000.96 | - |
| 000582 | 北部湾<br>港 | 2016年2<br>月29日 | 重大事<br>项 | 16.32 | -              | -     | 53  | 1,595.83  | 864.96   | - |

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基本资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性较小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末<br>2016年6月30日 | 1个月以内        | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年         | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-------------------|--------------|-------|--------|--------------|------|---------------|---------------|
| 资产                |              |       |        |              |      |               |               |
| 银行存款              | 1,105,655.06 | -     | -      | -            | -    | -             | 1,105,655.06  |
| 结算备付金             | 97,425.30    | -     | -      | -            | -    | -             | 97,425.30     |
| 存出保证金             | 2,969.27     | -     | -      | -            | -    | -             | 2,969.27      |
| 交易性金融资产           | -            | -     | -      | 1,519,050.00 | -    | 3,481,013.31  | 5,000,063.31  |
| 应收证券清算款           | -            | -     | -      | -            | -    | 7,001,477.78  | 7,001,477.78  |
| 应收利息              | -            | -     | -      | -            | -    | 13,955.19     | 13,955.19     |
| 资产总计              | 1,206,049.63 | -     | -      | 1,519,050.00 | -    | 10,496,446.28 | 13,221,545.91 |
| 负债                |              |       |        |              |      |               |               |
| 应付证券清算款           | -            | -     | -      | -            | -    | 6.00          | 6.00          |
| 应付赎回款             | -            | -     | -      | -            | -    | 65,773.70     | 65,773.70     |
| 应付管理人报酬           | -            | -     | -      | -            | -    | 16,289.31     | 16,289.31     |
| 应付托管费             | -            | -     | -      | -            | -    | 2,714.89      | 2,714.89      |
| 应付交易费用            | -            | -     | -      | -            | -    | 33,418.94     | 33,418.94     |
| 其他负债              | -            | -     | -      | -            | -    | 234,847.42    | 234,847.42    |

|         |              |   |   |               |                |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|----------------|---------------|
| 负债总计    | -            | - | - | -             | 353,050.26     | 353,050.26    |
| 利率敏感度缺口 | 1,206,049.63 | - | - | -1,519,050.00 | -10,143,396.02 | 12,868,495.65 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                  |                             |
|----|----------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                             |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                             |
|    | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动                        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                                  | 本期末（2016 年 6 月 30 日）        |
|    | +25 个基点                          | -6,365.42                   |
|    | -25 个基点                          | 6,365.42                    |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，本基金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%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |              |
|--------------|------------------------|--------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 3,481,013.31           | 27.05        |
| 交易性金融资产-基金投资 | -                      | -            |
| 交易性金融资产-债券投资 | 1,519,050.00           | 11.80        |

|               |              |       |
|---------------|--------------|-------|
| 交易性金融资产—贵金属投资 |              |       |
| 衍生金融资产—权证投资   |              |       |
| 其他            |              |       |
| 合计            | 5,000,063.31 | 38.86 |

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |  |
|----|---|--|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；   |  |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；  |  |
|    | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性（如基金成立日至期末不足一个年度的，以基金成立日至期末所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出）。 |  |
| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）<br>本期末（2016年6月30日） |
|    | +5%   | 462,004.27                                     |
|    | -5%   | -462,004.27                                    |

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告(转型前)

### 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              | 3,204,597.95  | 20.29        |
|    | 其中：股票             | 3,204,597.95  | 20.29        |
| 2  | 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            | -             | -            |
| 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 | 628,103.58    | 3.98   |
| 7 | 其他资产         | 151,386.69    | 0.96   |
| 8 | 合计           | 15,790,438.22 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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（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        |

### 7.2.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 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 |
| 11 | 600200 | 江苏吴中  | 1,418 | 26,800.20 | 0.19 |
| 12 | 600797 | 浙大网新  | 2,306 | 25,688.84 | 0.18 |
| 13 | 300244 | 迪安诊断  | 456   | 25,353.60 | 0.18 |
| 14 | 600654 | 中安消   | 964   | 23,646.92 | 0.17 |
| 15 | 600978 | 宜华生活  | 1,831 | 22,521.30 | 0.16 |
| 16 | 600645 | 中源协和  | 577   | 22,358.75 | 0.16 |
| 17 | 600575 | 皖江物流  | 4,271 | 21,611.26 | 0.15 |
| 18 | 600409 | 三友化工  | 2,635 | 20,368.55 | 0.15 |
| 19 | 600872 | 中炬高新  | 1,698 | 20,206.20 | 0.14 |
| 20 | 002048 | 宁波华翔  | 1,231 | 20,151.47 | 0.14 |
| 21 | 300147 | 香雪制药  | 1,345 | 20,000.15 | 0.14 |
| 22 | 601000 | 唐山港   | 2,534 | 19,587.82 | 0.14 |
| 23 | 600482 | 中国动力  | 569   | 19,493.94 | 0.14 |
| 24 | 002271 | 东方雨虹  | 1,168 | 19,470.56 | 0.14 |
| 25 | 000887 | 中鼎股份  | 838   | 18,603.60 | 0.13 |
| 26 | 000748 | 长城信息  | 957   | 18,594.51 | 0.13 |
| 27 | 000418 | 小天鹅 A | 621   | 18,443.70 | 0.13 |
| 28 | 002254 | 泰和新材  | 1,236 | 18,156.84 | 0.13 |
| 29 | 002466 | 天齐锂业  | 103   | 17,655.23 | 0.13 |
| 30 | 600410 | 华胜天成  | 1,130 | 17,515.00 | 0.13 |
| 31 | 600967 | 北方创业  | 1,403 | 16,569.43 | 0.12 |
| 32 | 600380 | 健康元   | 1,717 | 16,294.33 | 0.12 |
| 33 | 002672 | 东江环保  | 981   | 16,284.60 | 0.12 |
| 34 | 600312 | 平高电气  | 992   | 16,100.16 | 0.12 |
| 35 | 600643 | 爱建集团  | 1,474 | 15,639.14 | 0.11 |
| 36 | 600823 | 世茂股份  | 1,552 | 15,613.12 | 0.11 |
| 37 | 600566 | 济川药业  | 653   | 15,345.50 | 0.11 |
| 38 | 000566 | 海南海药  | 682   | 15,263.16 | 0.11 |
| 39 | 000869 | 张裕 A  | 412   | 15,239.88 | 0.11 |
| 40 | 000088 | 盐田港   | 2,256 | 15,024.96 | 0.11 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 41 | 600122 | 宏图高科 | 1,000 | 14,950.00 | 0.11 |
| 42 | 601139 | 深圳燃气 | 1,834 | 14,910.42 | 0.11 |
| 43 | 002701 | 奥瑞金  | 651   | 14,855.82 | 0.11 |
| 44 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,356 | 14,766.84 | 0.11 |
| 45 | 002482 | 广田集团 | 732   | 14,683.92 | 0.11 |
| 46 | 002368 | 太极股份 | 440   | 14,260.40 | 0.10 |
| 47 | 002276 | 万马股份 | 692   | 14,241.36 | 0.10 |
| 48 | 000697 | 炼石有色 | 597   | 14,208.60 | 0.10 |
| 49 | 002325 | 洪涛股份 | 1,315 | 13,636.55 | 0.10 |
| 50 | 002551 | 尚荣医疗 | 589   | 13,623.57 | 0.10 |
| 51 | 000732 | 泰禾集团 | 646   | 13,146.10 | 0.09 |
| 52 | 002223 | 鱼跃医疗 | 429   | 13,084.50 | 0.09 |
| 53 | 000426 | 兴业矿业 | 1,640 | 12,956.00 | 0.09 |
| 54 | 002405 | 四维图新 | 444   | 12,796.08 | 0.09 |
| 55 | 000631 | 顺发恒业 | 1,643 | 12,782.54 | 0.09 |
| 56 | 600366 | 宁波韵升 | 639   | 12,562.74 | 0.09 |
| 57 | 000592 | 平潭发展 | 900   | 12,492.00 | 0.09 |
| 58 | 600761 | 安徽合力 | 1,248 | 12,467.52 | 0.09 |
| 59 | 600587 | 新华医疗 | 500   | 12,275.00 | 0.09 |
| 60 | 000596 | 古井贡酒 | 339   | 12,180.27 | 0.09 |
| 61 | 600499 | 科达洁能 | 812   | 12,033.84 | 0.09 |
| 62 | 000066 | 长城电脑 | 972   | 11,868.12 | 0.08 |
| 63 | 600079 | 人福医药 | 712   | 11,612.72 | 0.08 |
| 64 | 600219 | 南山铝业 | 1,544 | 11,518.24 | 0.08 |
| 65 | 002573 | 清新环境 | 508   | 11,399.52 | 0.08 |
| 66 | 002414 | 高德红外 | 512   | 11,315.20 | 0.08 |
| 67 | 300291 | 华录百纳 | 500   | 11,150.00 | 0.08 |
| 68 | 000012 | 南玻A  | 1,023 | 11,027.94 | 0.08 |
| 69 | 600584 | 长电科技 | 607   | 10,998.84 | 0.08 |
| 70 | 000786 | 北新建材 | 1,206 | 10,986.66 | 0.08 |
| 71 | 002030 | 达安基因 | 341   | 10,748.32 | 0.08 |
| 72 | 002665 | 首航节能 | 425   | 10,552.75 | 0.08 |
| 73 | 002400 | 省广股份 | 580   | 10,550.20 | 0.08 |
| 74 | 600525 | 长园集团 | 680   | 10,356.40 | 0.07 |
| 75 | 000030 | 富奥股份 | 1,441 | 10,346.38 | 0.07 |
| 76 | 000919 | 金陵药业 | 837   | 10,328.58 | 0.07 |
| 77 | 000998 | 隆平高科 | 529   | 10,209.70 | 0.07 |
| 78 | 001696 | 宗申动力 | 998   | 10,169.62 | 0.07 |
| 79 | 000979 | 中弘股份 | 3,278 | 9,866.78  | 0.07 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 80  | 600635 | 大众公用 | 1,493 | 9,853.80 | 0.07 |
| 81  | 002508 | 老板电器 | 186   | 9,822.66 | 0.07 |
| 82  | 002419 | 天虹商场 | 706   | 9,799.28 | 0.07 |
| 83  | 600498 | 烽火通信 | 401   | 9,748.31 | 0.07 |
| 84  | 600664 | 哈药股份 | 1,151 | 9,737.46 | 0.07 |
| 85  | 600997 | 开滦股份 | 1,720 | 9,735.20 | 0.07 |
| 86  | 600816 | 安信信托 | 598   | 9,717.50 | 0.07 |
| 87  | 601311 | 骆驼股份 | 621   | 9,619.29 | 0.07 |
| 88  | 600416 | 湘电股份 | 790   | 9,559.00 | 0.07 |
| 89  | 600770 | 综艺股份 | 576   | 9,538.56 | 0.07 |
| 90  | 600175 | 美都能源 | 1,846 | 9,525.36 | 0.07 |
| 91  | 002308 | 威创股份 | 617   | 9,409.25 | 0.07 |
| 92  | 002489 | 浙江永强 | 1,169 | 9,352.00 | 0.07 |
| 93  | 600132 | 重庆啤酒 | 698   | 9,248.50 | 0.07 |
| 94  | 600694 | 大商股份 | 216   | 9,143.28 | 0.07 |
| 95  | 600655 | 豫园商城 | 770   | 9,024.40 | 0.06 |
| 96  | 002106 | 莱宝高科 | 1,054 | 8,980.08 | 0.06 |
| 97  | 600522 | 中天科技 | 467   | 8,919.70 | 0.06 |
| 98  | 600158 | 中体产业 | 480   | 8,836.80 | 0.06 |
| 99  | 600151 | 航天机电 | 812   | 8,834.56 | 0.06 |
| 100 | 600594 | 益佰制药 | 516   | 8,802.96 | 0.06 |
| 101 | 603188 | 亚邦股份 | 519   | 8,693.25 | 0.06 |
| 102 | 000650 | 仁和药业 | 1,093 | 8,634.70 | 0.06 |
| 103 | 002242 | 九阳股份 | 450   | 8,626.50 | 0.06 |
| 104 | 002219 | 恒康医疗 | 568   | 8,463.20 | 0.06 |
| 105 | 600487 | 亨通光电 | 705   | 8,424.75 | 0.06 |
| 106 | 002345 | 潮宏基  | 756   | 8,323.56 | 0.06 |
| 107 | 000997 | 新大陆  | 490   | 8,315.30 | 0.06 |
| 108 | 002004 | 华邦健康 | 872   | 8,310.16 | 0.06 |
| 109 | 000543 | 皖能电力 | 1,304 | 8,293.44 | 0.06 |
| 110 | 600500 | 中化国际 | 815   | 8,207.05 | 0.06 |
| 111 | 600478 | 科力远  | 496   | 8,154.24 | 0.06 |
| 112 | 600436 | 片仔癀  | 155   | 8,131.30 | 0.06 |
| 113 | 002285 | 世联行  | 959   | 8,122.73 | 0.06 |
| 114 | 002269 | 美邦服饰 | 1,795 | 8,113.40 | 0.06 |
| 115 | 600160 | 巨化股份 | 680   | 8,112.40 | 0.06 |
| 116 | 002049 | 紫光国芯 | 209   | 8,102.93 | 0.06 |
| 117 | 000951 | 中国重汽 | 477   | 8,099.46 | 0.06 |
| 118 | 000078 | 海王生物 | 442   | 8,066.50 | 0.06 |

|     |        |        |       |  |          |      |
|-----|--------|--------|-------|--|----------|------|
| 119 | 002444 | 巨星科技   | 413   |  | 8,032.85 | 0.06 |
| 120 | 000718 | 苏宁环球   | 789   |  | 8,032.02 | 0.06 |
| 121 | 002299 | 圣农发展   | 335   |  | 8,029.95 | 0.06 |
| 122 | 000921 | 海信科龙   | 1,050 |  | 7,980.00 | 0.06 |
| 123 | 002179 | 中航光电   | 222   |  | 7,956.48 | 0.06 |
| 124 | 000511 | *ST 烯碳 | 887   |  | 7,858.82 | 0.06 |
| 125 | 000547 | 航天发展   | 509   |  | 7,838.60 | 0.06 |
| 126 | 000988 | 华工科技   | 453   |  | 7,741.77 | 0.06 |
| 127 | 300267 | 尔康制药   | 258   |  | 7,675.50 | 0.05 |
| 128 | 603899 | 晨光文具   | 207   |  | 7,615.53 | 0.05 |
| 129 | 600790 | 轻纺城    | 1,286 |  | 7,523.10 | 0.05 |
| 130 | 600138 | 中青旅    | 374   |  | 7,483.74 | 0.05 |
| 131 | 300253 | 卫宁健康   | 254   |  | 7,467.60 | 0.05 |
| 132 | 600851 | 海欣股份   | 533   |  | 7,446.01 | 0.05 |
| 133 | 600216 | 浙江医药   | 505   |  | 7,362.90 | 0.05 |
| 134 | 600601 | 方正科技   | 1,631 |  | 7,339.50 | 0.05 |
| 135 | 600026 | 中海发展   | 1,106 |  | 7,310.66 | 0.05 |
| 136 | 002203 | 海亮股份   | 992   |  | 7,271.36 | 0.05 |
| 137 | 002727 | 一心堂    | 334   |  | 7,267.84 | 0.05 |
| 138 | 600425 | 青松建化   | 1,565 |  | 7,261.60 | 0.05 |
| 139 | 002309 | 中利科技   | 503   |  | 7,213.02 | 0.05 |
| 140 | 600435 | 北方导航   | 323   |  | 7,167.37 | 0.05 |
| 141 | 600143 | 金发科技   | 1,163 |  | 7,140.82 | 0.05 |
| 142 | 600673 | 东阳光科   | 949   |  | 7,098.52 | 0.05 |
| 143 | 600528 | 中铁二局   | 565   |  | 7,011.65 | 0.05 |
| 144 | 601965 | 中国汽研   | 822   |  | 6,978.78 | 0.05 |
| 145 | 600811 | 东方集团   | 1,046 |  | 6,934.98 | 0.05 |
| 146 | 000669 | 金鸿能源   | 415   |  | 6,930.50 | 0.05 |
| 147 | 600759 | 洲际油气   | 840   |  | 6,896.40 | 0.05 |
| 148 | 000031 | 中粮地产   | 670   |  | 6,894.30 | 0.05 |
| 149 | 000829 | 天音控股   | 490   |  | 6,864.90 | 0.05 |
| 150 | 000930 | 中粮生化   | 578   |  | 6,797.28 | 0.05 |
| 151 | 600086 | 东方金钰   | 747   |  | 6,775.29 | 0.05 |
| 152 | 002340 | 格林美    | 652   |  | 6,761.24 | 0.05 |
| 153 | 002595 | 豪迈科技   | 353   |  | 6,759.95 | 0.05 |
| 154 | 600240 | XD 华业资 | 639   |  | 6,754.23 | 0.05 |
| 155 | 600176 | 中国巨石   | 319   |  | 6,721.33 | 0.05 |
| 156 | 002013 | 中航机电   | 354   |  | 6,690.60 | 0.05 |
| 157 | 002437 | 誉衡药业   | 225   |  | 6,675.75 | 0.05 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 158 | 000690 | 宝新能源 | 916   | 6,668.48 | 0.05 |
| 159 | 603328 | 依顿电子 | 285   | 6,597.75 | 0.05 |
| 160 | 600651 | 飞乐音响 | 520   | 6,588.40 | 0.05 |
| 161 | 600418 | 江淮汽车 | 566   | 6,588.24 | 0.05 |
| 162 | 600884 | 杉杉股份 | 217   | 6,536.04 | 0.05 |
| 163 | 000758 | 中色股份 | 442   | 6,470.88 | 0.05 |
| 164 | 002161 | 远望谷  | 457   | 6,425.42 | 0.05 |
| 165 | 300199 | 翰宇药业 | 347   | 6,395.21 | 0.05 |
| 166 | 002273 | 水晶光电 | 203   | 6,355.93 | 0.05 |
| 167 | 000852 | 石化机械 | 413   | 6,318.90 | 0.05 |
| 168 | 600699 | 均胜电子 | 189   | 6,289.92 | 0.05 |
| 169 | 300088 | 长信科技 | 532   | 6,266.96 | 0.04 |
| 170 | 600064 | 南京高科 | 410   | 6,252.50 | 0.04 |
| 171 | 000028 | 国药一致 | 93    | 6,240.30 | 0.04 |
| 172 | 002168 | 深圳惠程 | 442   | 6,232.20 | 0.04 |
| 173 | 600183 | 生益科技 | 737   | 6,176.06 | 0.04 |
| 174 | 600426 | 华鲁恒升 | 505   | 6,166.05 | 0.04 |
| 175 | 600171 | 上海贝岭 | 395   | 6,130.40 | 0.04 |
| 176 | 002022 | 科华生物 | 315   | 6,129.90 | 0.04 |
| 177 | 000762 | 西藏矿业 | 284   | 6,125.88 | 0.04 |
| 178 | 600755 | 厦门国贸 | 862   | 6,120.20 | 0.04 |
| 179 | 600869 | 智慧能源 | 846   | 6,108.12 | 0.04 |
| 180 | 002266 | 浙富控股 | 1,062 | 6,085.26 | 0.04 |
| 181 | 002250 | 联化科技 | 421   | 6,037.14 | 0.04 |
| 182 | 600880 | 博瑞传播 | 619   | 6,029.06 | 0.04 |
| 183 | 600611 | 大众交通 | 524   | 6,010.28 | 0.04 |
| 184 | 600325 | 华发股份 | 487   | 5,985.23 | 0.04 |
| 185 | 600536 | 中国软件 | 235   | 5,903.20 | 0.04 |
| 186 | 002244 | 滨江集团 | 830   | 5,859.80 | 0.04 |
| 187 | 600511 | 国药股份 | 212   | 5,834.24 | 0.04 |
| 188 | 600298 | 安琪酵母 | 152   | 5,826.16 | 0.04 |
| 189 | 300115 | 长盈精密 | 193   | 5,809.30 | 0.04 |
| 189 | 000671 | 阳光城  | 965   | 5,809.30 | 0.04 |
| 190 | 000006 | 深振业A | 707   | 5,804.47 | 0.04 |
| 191 | 600628 | 新世界  | 468   | 5,803.20 | 0.04 |
| 192 | 002431 | 棕榈股份 | 215   | 5,800.70 | 0.04 |
| 193 | 600422 | 昆药集团 | 203   | 5,726.63 | 0.04 |
| 194 | 600704 | 物产中大 | 453   | 5,725.92 | 0.04 |
| 195 | 600320 | 振华重工 | 1,281 | 5,687.64 | 0.04 |

|     |        |      |       |  |          |      |
|-----|--------|------|-------|--|----------|------|
| 196 | 002477 | 雏鹰农牧 | 317   |  | 5,652.11 | 0.04 |
| 197 | 600754 | 锦江股份 | 149   |  | 5,626.24 | 0.04 |
| 198 | 000616 | 海航投资 | 1,077 |  | 5,621.94 | 0.04 |
| 199 | 600187 | 国中水务 | 1,101 |  | 5,615.10 | 0.04 |
| 200 | 300043 | 互动娱乐 | 354   |  | 5,593.20 | 0.04 |
| 201 | 002155 | 湖南黄金 | 519   |  | 5,553.30 | 0.04 |
| 202 | 600169 | 太原重工 | 1,320 |  | 5,544.00 | 0.04 |
| 203 | 002092 | 中泰化学 | 723   |  | 5,523.72 | 0.04 |
| 204 | 600198 | 大唐电信 | 319   |  | 5,518.70 | 0.04 |
| 205 | 600433 | 冠豪高新 | 593   |  | 5,508.97 | 0.04 |
| 206 | 600787 | 中储股份 | 687   |  | 5,489.13 | 0.04 |
| 207 | 000667 | 美好集团 | 1,374 |  | 5,454.78 | 0.04 |
| 208 | 002190 | 成飞集成 | 153   |  | 5,437.62 | 0.04 |
| 209 | 002143 | 印纪传媒 | 211   |  | 5,437.47 | 0.04 |
| 210 | 000488 | 晨鸣纸业 | 655   |  | 5,436.50 | 0.04 |
| 211 | 600017 | 日照港  | 1,196 |  | 5,382.00 | 0.04 |
| 212 | 600056 | 中国医药 | 397   |  | 5,371.41 | 0.04 |
| 213 | 600259 | 广晟有色 | 101   |  | 5,360.07 | 0.04 |
| 214 | 000519 | 江南红箭 | 454   |  | 5,334.50 | 0.04 |
| 215 | 600765 | 中航重机 | 359   |  | 5,313.20 | 0.04 |
| 216 | 002428 | 云南锗业 | 329   |  | 5,310.06 | 0.04 |
| 217 | 000552 | 靖远煤电 | 634   |  | 5,255.86 | 0.04 |
| 218 | 002681 | 奋达科技 | 156   |  | 5,229.12 | 0.04 |
| 219 | 600270 | 外运发展 | 276   |  | 5,177.76 | 0.04 |
| 220 | 002237 | 恒邦股份 | 509   |  | 5,171.44 | 0.04 |
| 221 | 600517 | 置信电气 | 550   |  | 5,153.50 | 0.04 |
| 222 | 300273 | 和佳股份 | 340   |  | 5,151.00 | 0.04 |
| 223 | 600572 | 康恩贝  | 527   |  | 5,148.79 | 0.04 |
| 224 | 000939 | 凯迪生态 | 567   |  | 5,148.36 | 0.04 |
| 225 | 600067 | 冠城大通 | 768   |  | 5,137.92 | 0.04 |
| 226 | 002503 | 搜于特  | 426   |  | 5,133.30 | 0.04 |
| 227 | 600808 | 马钢股份 | 1,828 |  | 5,118.40 | 0.04 |
| 228 | 603766 | 隆鑫通用 | 298   |  | 5,101.76 | 0.04 |
| 229 | 600885 | 宏发股份 | 206   |  | 5,084.08 | 0.04 |
| 230 | 002073 | 软控股份 | 452   |  | 5,075.96 | 0.04 |
| 231 | 600835 | 上海机电 | 242   |  | 5,057.80 | 0.04 |
| 232 | 000656 | 金科股份 | 1,279 |  | 5,052.05 | 0.04 |
| 233 | 002384 | 东山精密 | 284   |  | 5,004.08 | 0.04 |
| 234 | 600335 | 国机汽车 | 278   |  | 4,987.32 | 0.04 |

|     |        |       |       |          |      |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 235 | 000021 | 深科技   | 569   | 4,984.44 | 0.04 |
| 236 | 600161 | 天坛生物  | 187   | 4,968.59 | 0.04 |
| 237 | 002221 | 东华能源  | 215   | 4,966.50 | 0.04 |
| 238 | 002005 | 德豪润达  | 761   | 4,946.50 | 0.04 |
| 239 | 000926 | 福星股份  | 420   | 4,905.60 | 0.04 |
| 240 | 600736 | 苏州高新  | 569   | 4,899.09 | 0.04 |
| 241 | 002440 | 闰土股份  | 292   | 4,893.92 | 0.04 |
| 242 | 002063 | 远光软件  | 358   | 4,886.70 | 0.03 |
| 243 | 600392 | 盛和资源  | 350   | 4,861.50 | 0.03 |
| 244 | 000969 | 安泰科技  | 399   | 4,839.87 | 0.03 |
| 245 | 000681 | 视觉中国  | 195   | 4,816.50 | 0.03 |
| 246 | 000587 | 金洲慈航  | 296   | 4,786.32 | 0.03 |
| 247 | 000541 | 佛山照明  | 523   | 4,785.45 | 0.03 |
| 248 | 600220 | 江苏阳光  | 1,119 | 4,778.13 | 0.03 |
| 249 | 600580 | 卧龙电气  | 401   | 4,755.86 | 0.03 |
| 250 | 000975 | 银泰资源  | 317   | 4,755.00 | 0.03 |
| 251 | 600859 | 王府井   | 225   | 4,736.25 | 0.03 |
| 252 | 000685 | 中山公用  | 432   | 4,726.08 | 0.03 |
| 253 | 000777 | 中核科技  | 202   | 4,704.58 | 0.03 |
| 254 | 000973 | 佛塑科技  | 568   | 4,703.04 | 0.03 |
| 255 | 600289 | 亿阳信通  | 350   | 4,697.00 | 0.03 |
| 256 | 600831 | 广电网络  | 359   | 4,674.18 | 0.03 |
| 257 | 600058 | 五矿发展  | 296   | 4,644.24 | 0.03 |
| 258 | 600614 | 鼎立股份  | 626   | 4,638.66 | 0.03 |
| 259 | 600351 | 亚宝药业  | 424   | 4,596.16 | 0.03 |
| 260 | 600557 | 康缘药业  | 259   | 4,592.07 | 0.03 |
| 261 | 000612 | 焦作万方  | 772   | 4,585.68 | 0.03 |
| 262 | 002174 | 游族网络  | 132   | 4,576.44 | 0.03 |
| 263 | 002011 | 盾安环境  | 406   | 4,571.56 | 0.03 |
| 264 | 600062 | 华润双鹤  | 266   | 4,548.60 | 0.03 |
| 265 | 000572 | 海马汽车  | 888   | 4,546.56 | 0.03 |
| 266 | 300134 | 大富科技  | 201   | 4,534.56 | 0.03 |
| 267 | 600284 | 浦东建设  | 416   | 4,534.40 | 0.03 |
| 268 | 600039 | 四川路桥  | 1,141 | 4,529.77 | 0.03 |
| 269 | 600260 | 凯乐科技  | 360   | 4,496.40 | 0.03 |
| 270 | 000563 | 陕国投 A | 748   | 4,480.52 | 0.03 |
| 271 | 600120 | 浙江东方  | 225   | 4,468.50 | 0.03 |
| 272 | 600970 | 中材国际  | 445   | 4,450.00 | 0.03 |
| 273 | 601717 | 郑煤机   | 709   | 4,431.25 | 0.03 |

|     |        |        |       |  |          |      |
|-----|--------|--------|-------|--|----------|------|
| 274 | 000897 | 津滨发展   | 1,001 |  | 4,424.42 | 0.03 |
| 275 | 600125 | 铁龙物流   | 661   |  | 4,422.09 | 0.03 |
| 276 | 002025 | 航天电器   | 191   |  | 4,398.73 | 0.03 |
| 277 | 000401 | 冀东水泥   | 403   |  | 4,392.70 | 0.03 |
| 278 | 600428 | 中远航运   | 638   |  | 4,389.44 | 0.03 |
| 279 | 601880 | 大连港    | 754   |  | 4,350.58 | 0.03 |
| 280 | 002050 | 三花股份   | 587   |  | 4,349.67 | 0.03 |
| 281 | 000513 | 丽珠集团   | 96    |  | 4,348.80 | 0.03 |
| 282 | 002461 | 珠江啤酒   | 361   |  | 4,346.44 | 0.03 |
| 283 | 600267 | 海正药业   | 357   |  | 4,312.56 | 0.03 |
| 284 | 000062 | 深圳华强   | 174   |  | 4,278.66 | 0.03 |
| 285 | 002078 | 太阳纸业   | 758   |  | 4,267.54 | 0.03 |
| 286 | 600805 | 悦达投资   | 507   |  | 4,263.87 | 0.03 |
| 287 | 002588 | 史丹利    | 169   |  | 4,257.11 | 0.03 |
| 288 | 600826 | 兰生股份   | 156   |  | 4,251.00 | 0.03 |
| 289 | 000933 | *ST 神火 | 850   |  | 4,241.50 | 0.03 |
| 290 | 002396 | 星网锐捷   | 204   |  | 4,212.60 | 0.03 |
| 291 | 600750 | 江中药业   | 138   |  | 4,202.10 | 0.03 |
| 292 | 002642 | 荣之联    | 100   |  | 4,202.00 | 0.03 |
| 293 | 000961 | 中南建设   | 259   |  | 4,162.13 | 0.03 |
| 294 | 600004 | 白云机场   | 343   |  | 4,157.16 | 0.03 |
| 295 | 000693 | ST 华泽  | 332   |  | 4,150.00 | 0.03 |
| 296 | 000528 | 柳 工    | 588   |  | 4,145.40 | 0.03 |
| 297 | 000848 | 承德露露   | 332   |  | 4,133.40 | 0.03 |
| 298 | 601886 | 江河集团   | 341   |  | 4,132.92 | 0.03 |
| 299 | 603077 | 和邦生物   | 810   |  | 4,131.00 | 0.03 |
| 300 | 000680 | 山推股份   | 725   |  | 4,125.25 | 0.03 |
| 301 | 002056 | 横店东磁   | 154   |  | 4,116.42 | 0.03 |
| 302 | 601233 | 桐昆股份   | 312   |  | 4,056.00 | 0.03 |
| 303 | 600458 | 时代新材   | 309   |  | 4,054.08 | 0.03 |
| 304 | 002358 | 森源电气   | 246   |  | 3,995.04 | 0.03 |
| 305 | 600812 | 华北制药   | 603   |  | 3,985.83 | 0.03 |
| 306 | 000550 | 江铃汽车   | 156   |  | 3,931.20 | 0.03 |
| 307 | 002238 | 天威视讯   | 226   |  | 3,912.06 | 0.03 |
| 308 | 600894 | 广日股份   | 260   |  | 3,902.60 | 0.03 |
| 309 | 601666 | 平煤股份   | 879   |  | 3,893.97 | 0.03 |
| 310 | 000600 | 建投能源   | 413   |  | 3,873.94 | 0.03 |
| 311 | 000830 | 鲁西化工   | 755   |  | 3,873.15 | 0.03 |
| 312 | 601126 | 四方股份   | 350   |  | 3,825.50 | 0.03 |

|     |        |       |     |          |      |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 313 | 000099 | 中信海直  | 313 | 3,818.60 | 0.03 |
| 314 | 600481 | 双良节能  | 616 | 3,813.04 | 0.03 |
| 315 | 600729 | 重庆百货  | 175 | 3,811.50 | 0.03 |
| 316 | 000816 | 智慧农业  | 625 | 3,806.25 | 0.03 |
| 317 | 000090 | 天健集团  | 280 | 3,780.00 | 0.03 |
| 318 | 002093 | 国脉科技  | 337 | 3,774.40 | 0.03 |
| 319 | 000900 | 现代投资  | 531 | 3,748.86 | 0.03 |
| 320 | 000726 | 鲁 泰 A | 341 | 3,744.18 | 0.03 |
| 321 | 000652 | 泰达股份  | 761 | 3,744.12 | 0.03 |
| 322 | 002317 | 众生药业  | 338 | 3,741.66 | 0.03 |
| 323 | 000636 | 风华高科  | 421 | 3,734.27 | 0.03 |
| 324 | 000049 | 德赛电池  | 95  | 3,701.20 | 0.03 |
| 325 | 002249 | 大洋电机  | 399 | 3,694.74 | 0.03 |
| 326 | 600073 | 上海梅林  | 357 | 3,687.81 | 0.03 |
| 327 | 002041 | 登海种业  | 270 | 3,682.80 | 0.03 |
| 328 | 600563 | 法拉电子  | 106 | 3,677.14 | 0.03 |
| 329 | 600006 | 东风汽车  | 590 | 3,663.90 | 0.03 |
| 330 | 600993 | 马应龙   | 224 | 3,644.48 | 0.03 |
| 331 | 002028 | 思源电气  | 273 | 3,630.90 | 0.03 |
| 332 | 300039 | 上海凯宝  | 366 | 3,594.12 | 0.03 |
| 333 | 002390 | 信邦制药  | 380 | 3,587.20 | 0.03 |
| 334 | 600337 | 美克家居  | 286 | 3,540.68 | 0.03 |
| 335 | 601678 | 滨化股份  | 524 | 3,537.00 | 0.03 |
| 336 | 002029 | 七 匹 狼 | 358 | 3,529.88 | 0.03 |
| 337 | 000603 | 盛达矿业  | 180 | 3,524.40 | 0.03 |
| 338 | 300202 | 聚龙股份  | 163 | 3,504.50 | 0.03 |
| 339 | 002122 | 天马股份  | 521 | 3,501.12 | 0.03 |
| 340 | 603019 | 中科曙光  | 51  | 3,482.28 | 0.02 |
| 341 | 002233 | 塔牌集团  | 385 | 3,476.55 | 0.02 |
| 342 | 600112 | 天成控股  | 298 | 3,468.72 | 0.02 |
| 343 | 002635 | 安洁科技  | 109 | 3,442.22 | 0.02 |
| 344 | 600757 | 长江传媒  | 452 | 3,408.08 | 0.02 |
| 345 | 601001 | 大同煤业  | 624 | 3,394.56 | 0.02 |
| 346 | 000931 | 中 关 村 | 391 | 3,393.88 | 0.02 |
| 347 | 600748 | 上实发展  | 328 | 3,384.96 | 0.02 |
| 348 | 002281 | 光迅科技  | 62  | 3,359.78 | 0.02 |
| 349 | 600300 | 维维股份  | 617 | 3,307.12 | 0.02 |
| 350 | 000860 | 顺鑫农业  | 173 | 3,297.38 | 0.02 |
| 351 | 600292 | 远达环保  | 237 | 3,294.30 | 0.02 |

|     |        |       |     |  |          |      |
|-----|--------|-------|-----|--|----------|------|
| 352 | 002479 | 富春环保  | 280 |  | 3,292.80 | 0.02 |
| 353 | 002663 | 普邦园林  | 491 |  | 3,274.97 | 0.02 |
| 354 | 600586 | 金晶科技  | 746 |  | 3,274.94 | 0.02 |
| 355 | 600720 | 祁连山   | 465 |  | 3,259.65 | 0.02 |
| 356 | 600639 | 浦东金桥  | 193 |  | 3,257.84 | 0.02 |
| 357 | 600460 | 士兰微   | 563 |  | 3,248.51 | 0.02 |
| 358 | 601369 | 陕鼓动力  | 495 |  | 3,242.25 | 0.02 |
| 359 | 000501 | 鄂武商 A | 189 |  | 3,237.57 | 0.02 |
| 360 | 600059 | 古越龙山  | 365 |  | 3,233.90 | 0.02 |
| 361 | 002277 | 友阿股份  | 303 |  | 3,217.86 | 0.02 |
| 362 | 600825 | 新华传媒  | 390 |  | 3,209.70 | 0.02 |
| 363 | 600496 | 精工钢构  | 670 |  | 3,195.90 | 0.02 |
| 364 | 000417 | 合肥百货  | 403 |  | 3,195.79 | 0.02 |
| 365 | 601908 | 京运通   | 486 |  | 3,188.16 | 0.02 |
| 366 | 600509 | 天富能源  | 413 |  | 3,184.23 | 0.02 |
| 367 | 600596 | 新安股份  | 409 |  | 3,169.75 | 0.02 |
| 368 | 002373 | 千方科技  | 101 |  | 3,168.37 | 0.02 |
| 369 | 600195 | 中牧股份  | 178 |  | 3,157.72 | 0.02 |
| 370 | 600803 | 新奥股份  | 252 |  | 3,157.56 | 0.02 |
| 371 | 000620 | 新华联   | 449 |  | 3,156.47 | 0.02 |
| 372 | 002408 | 齐翔腾达  | 252 |  | 3,144.96 | 0.02 |
| 373 | 601777 | 力帆股份  | 291 |  | 3,139.89 | 0.02 |
| 374 | 600545 | 新疆城建  | 399 |  | 3,092.25 | 0.02 |
| 375 | 002293 | 罗莱生活  | 214 |  | 3,081.60 | 0.02 |
| 376 | 600251 | 冠农股份  | 354 |  | 3,076.26 | 0.02 |
| 377 | 600864 | 哈投股份  | 242 |  | 3,073.40 | 0.02 |
| 378 | 002342 | 巨力索具  | 521 |  | 3,068.69 | 0.02 |
| 379 | 002181 | 粤传媒   | 348 |  | 3,062.40 | 0.02 |
| 380 | 600180 | 瑞茂通   | 198 |  | 3,061.08 | 0.02 |
| 381 | 601801 | 皖新传媒  | 135 |  | 3,030.75 | 0.02 |
| 382 | 600537 | 亿晶光电  | 228 |  | 3,009.60 | 0.02 |
| 383 | 002064 | 华峰氨纶  | 631 |  | 2,997.25 | 0.02 |
| 384 | 002194 | 武汉凡谷  | 251 |  | 2,981.88 | 0.02 |
| 385 | 000703 | 恒逸石化  | 258 |  | 2,961.84 | 0.02 |
| 386 | 601002 | 晋亿实业  | 354 |  | 2,952.36 | 0.02 |
| 387 | 000877 | 天山股份  | 461 |  | 2,950.40 | 0.02 |
| 388 | 002315 | 焦点科技  | 45  |  | 2,938.05 | 0.02 |
| 389 | 002698 | 博实股份  | 156 |  | 2,925.00 | 0.02 |
| 390 | 002140 | 东华科技  | 171 |  | 2,924.10 | 0.02 |

|     |        |        |     |          |      |
|-----|--------|--------|-----|----------|------|
| 391 | 600546 | *ST 山煤 | 727 | 2,922.54 | 0.02 |
| 392 | 002371 | 七星电子   | 129 | 2,919.27 | 0.02 |
| 393 | 002251 | 步步高    | 230 | 2,916.40 | 0.02 |
| 394 | 000861 | 海印股份   | 498 | 2,908.32 | 0.02 |
| 395 | 002332 | 仙琚制药   | 263 | 2,882.48 | 0.02 |
| 396 | 600773 | 西藏城投   | 215 | 2,881.00 | 0.02 |
| 397 | 002463 | 沪电股份   | 619 | 2,797.88 | 0.02 |
| 398 | 002118 | 紫鑫药业   | 193 | 2,727.09 | 0.02 |
| 399 | 600456 | 宝钛股份   | 167 | 2,725.44 | 0.02 |
| 400 | 002267 | 陕天然气   | 275 | 2,706.00 | 0.02 |
| 401 | 600329 | 中新药业   | 157 | 2,687.84 | 0.02 |
| 402 | 600640 | 号百控股   | 157 | 2,636.03 | 0.02 |
| 403 | 600874 | 创业环保   | 324 | 2,621.16 | 0.02 |
| 404 | 600657 | 信达地产   | 461 | 2,618.48 | 0.02 |
| 405 | 603699 | 纽威股份   | 154 | 2,610.30 | 0.02 |
| 406 | 600088 | 中视传媒   | 122 | 2,592.50 | 0.02 |
| 407 | 601101 | 昊华能源   | 356 | 2,538.28 | 0.02 |
| 408 | 601005 | 重庆钢铁   | 904 | 2,531.20 | 0.02 |
| 409 | 600551 | 时代出版   | 152 | 2,530.80 | 0.02 |
| 410 | 600618 | 氯碱化工   | 167 | 2,520.03 | 0.02 |
| 411 | 600850 | 华东电脑   | 73  | 2,516.31 | 0.02 |
| 412 | 600141 | 兴发集团   | 239 | 2,507.11 | 0.02 |
| 413 | 600617 | 国新能源   | 203 | 2,478.63 | 0.02 |
| 414 | 603555 | 贵人鸟    | 95  | 2,434.85 | 0.02 |
| 415 | 002392 | 北京利尔   | 452 | 2,413.68 | 0.02 |
| 416 | 600429 | 三元股份   | 336 | 2,375.52 | 0.02 |
| 417 | 600507 | 方大特钢   | 393 | 2,369.79 | 0.02 |
| 418 | 601010 | 文峰股份   | 416 | 2,333.76 | 0.02 |
| 419 | 600776 | 东方通信   | 287 | 2,313.22 | 0.02 |
| 420 | 002204 | 大连重工   | 291 | 2,301.81 | 0.02 |
| 421 | 600971 | 恒源煤电   | 372 | 2,287.80 | 0.02 |
| 422 | 002646 | 青青稞酒   | 132 | 2,263.80 | 0.02 |
| 423 | 002216 | 三全食品   | 246 | 2,214.00 | 0.02 |
| 424 | 002327 | 富安娜    | 256 | 2,186.24 | 0.02 |
| 425 | 600184 | 光电股份   | 95  | 2,081.45 | 0.01 |
| 426 | 000525 | 红太阳    | 153 | 2,079.27 | 0.01 |
| 427 | 600743 | 华远地产   | 398 | 2,065.62 | 0.01 |
| 428 | 603001 | 奥康国际   | 92  | 2,035.96 | 0.01 |
| 429 | 603169 | 兰石重装   | 153 | 2,019.60 | 0.01 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 430 | 002128 | 露天煤业 | 248 | 2,003.84 | 0.01 |
| 431 | 603366 | 日出东方 | 239 | 1,976.53 | 0.01 |
| 432 | 600510 | 黑牡丹  | 235 | 1,945.80 | 0.01 |
| 433 | 601515 | 东风股份 | 170 | 1,939.70 | 0.01 |
| 434 | 600780 | 通宝能源 | 341 | 1,831.17 | 0.01 |
| 435 | 600280 | 中央商场 | 256 | 1,771.52 | 0.01 |
| 436 | 002648 | 卫星石化 | 189 | 1,733.13 | 0.01 |
| 437 | 603005 | 晶方科技 | 51  | 1,727.37 | 0.01 |
| 438 | 002678 | 珠江钢琴 | 141 | 1,714.56 | 0.01 |
| 439 | 600917 | 重庆燃气 | 154 | 1,609.30 | 0.01 |
| 440 | 600468 | 百利电气 | 134 | 1,536.98 | 0.01 |
| 441 | 600397 | 安源煤业 | 294 | 1,531.74 | 0.01 |
| 442 | 601226 | 华电重工 | 157 | 1,497.78 | 0.01 |
| 443 | 603369 | 今世缘  | 45  | 1,448.55 | 0.01 |
| 444 | 603698 | 航天工程 | 51  | 1,438.20 | 0.01 |
| 445 | 002430 | 杭氧股份 | 180 | 1,413.00 | 0.01 |
| 446 | 000719 | 大地传媒 | 93  | 1,364.31 | 0.01 |
| 447 | 600801 | 华新水泥 | 148 | 1,173.64 | 0.01 |
| 448 | 000582 | 北部湾港 | 53  | 868.14   | 0.01 |

## 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

注：本基金本报告期内未买入股票。

### 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  | 000982 | 中银绒业 | 39,157.74 | 0.25           |
| 2  | 002091 | 江苏国泰 | 7,827.18  | 0.05           |

### 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 | -         |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 46,984.92 |

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 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  | 中期票据      | -             | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -             |
| 8  | 同业存单      | -             | -             |
| 9  | 其他        | -             | -             |
| 10 | 合计        | 11,806,350.00 | 84.55         |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 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。

## 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持有股指期货。

### 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。**

**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 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 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 |

### 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 2016 年 4 月 24 日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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 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     |

### 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。

## § 7 投资组合报告(转型后)

### 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              | 3,481,013.31  | 26.33         |
|    | 其中：股票             | 3,481,013.31  | 26.33         |
| 2  | 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            | -             | -             |
| 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      | 1,203,080.36  | 9.10          |
| 7  | 其他资产              | 7,018,402.24  | 53.08         |
| 8  | 合计                | 13,221,545.91 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（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 |

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

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  | 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         |
| 11 | 300024 | 机器人  | 1,100 | 27,929.00 | 0.22         |
| 12 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,000 | 27,080.00 | 0.21         |
| 13 | 300134 | 大富科技 | 900   | 26,964.00 | 0.21         |
| 14 | 300085 | 银之杰  | 900   | 26,910.00 | 0.21         |
| 15 | 300156 | 神雾环保 | 1,300 | 26,754.00 | 0.21         |
| 16 | 300113 | 顺网科技 | 700   | 26,572.00 | 0.21         |
| 17 | 300199 | 翰宇药业 | 1,300 | 26,455.00 | 0.21         |
| 18 | 300347 | 泰格医药 | 900   | 26,118.00 | 0.20         |
| 19 | 300291 | 华录百纳 | 1,100 | 25,883.00 | 0.20         |
| 20 | 300011 | 鼎汉技术 | 1,100 | 25,817.00 | 0.20         |
| 21 | 300267 | 尔康制药 | 1,800 | 25,776.00 | 0.20         |
| 22 | 300015 | 爱尔眼科 | 700   | 25,571.00 | 0.20         |
| 23 | 300002 | 神州泰岳 | 2,400 | 25,536.00 | 0.20         |
| 24 | 300043 | 互动娱乐 | 1,800 | 25,506.00 | 0.20         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 25 | 300288 | 朗玛信息 | 700   | 25,382.00 | 0.20 |
| 26 | 300433 | 蓝思科技 | 900   | 25,308.00 | 0.20 |
| 27 | 300070 | 碧水源  | 1,700 | 25,296.00 | 0.20 |
| 28 | 300058 | 蓝色光标 | 2,600 | 25,246.00 | 0.20 |
| 29 | 300124 | 汇川技术 | 1,300 | 25,220.00 | 0.20 |
| 30 | 300315 | 掌趣科技 | 2,400 | 25,176.00 | 0.20 |
| 31 | 300101 | 振芯科技 | 900   | 25,137.00 | 0.20 |
| 32 | 300339 | 润和软件 | 700   | 25,088.00 | 0.19 |
| 33 | 300178 | 腾邦国际 | 1,300 | 24,960.00 | 0.19 |
| 34 | 300273 | 和佳股份 | 1,300 | 24,895.00 | 0.19 |
| 35 | 300072 | 三聚环保 | 900   | 24,876.00 | 0.19 |
| 36 | 300257 | 开山股份 | 1,500 | 24,780.00 | 0.19 |
| 37 | 300012 | 华测检测 | 2,000 | 24,760.00 | 0.19 |
| 38 | 300271 | 华宇软件 | 1,300 | 24,596.00 | 0.19 |
| 39 | 300171 | 东富龙  | 1,300 | 24,544.00 | 0.19 |
| 40 | 300033 | 同花顺  | 300   | 24,435.00 | 0.19 |
| 41 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,800 | 24,372.00 | 0.19 |
| 42 | 300034 | 钢研高纳 | 1,100 | 24,310.00 | 0.19 |
| 43 | 300251 | 光线传媒 | 2,100 | 24,276.00 | 0.19 |
| 44 | 300352 | 北信源  | 1,300 | 24,271.00 | 0.19 |
| 45 | 300020 | 银江股份 | 1,300 | 24,180.00 | 0.19 |
| 46 | 300287 | 飞利信  | 1,800 | 24,120.00 | 0.19 |
| 46 | 300032 | 金龙机电 | 1,200 | 24,120.00 | 0.19 |
| 47 | 300231 | 银信科技 | 1,300 | 23,972.00 | 0.19 |
| 48 | 300001 | 特锐德  | 1,100 | 23,859.00 | 0.19 |
| 49 | 300183 | 东软载波 | 900   | 23,850.00 | 0.19 |
| 50 | 300096 | 易联众  | 1,300 | 23,842.00 | 0.19 |
| 51 | 300203 | 聚光科技 | 900   | 23,760.00 | 0.18 |
| 52 | 300003 | 乐普医疗 | 1,300 | 23,712.00 | 0.18 |
| 53 | 300055 | 万邦达  | 1,300 | 23,673.00 | 0.18 |
| 54 | 300324 | 旋极信息 | 1,100 | 23,606.00 | 0.18 |
| 55 | 300053 | 欧比特  | 1,300 | 23,595.00 | 0.18 |
| 56 | 300111 | 向日葵  | 4,800 | 23,520.00 | 0.18 |
| 57 | 300229 | 拓尔思  | 1,100 | 23,518.00 | 0.18 |
| 58 | 300159 | 新研股份 | 1,300 | 23,465.00 | 0.18 |
| 59 | 300133 | 华策影视 | 1,500 | 23,355.00 | 0.18 |
| 60 | 300408 | 三环集团 | 1,300 | 23,348.00 | 0.18 |
| 61 | 300122 | 智飞生物 | 1,500 | 23,205.00 | 0.18 |
| 62 | 300252 | 金信诺  | 700   | 23,191.00 | 0.18 |

|     |        |        |       |           |      |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 63  | 300276 | 三丰智能   | 1,100 | 23,166.00 | 0.18 |
| 64  | 300207 | 欣旺达    | 900   | 23,103.00 | 0.18 |
| 65  | 300244 | 迪安诊断   | 700   | 23,086.00 | 0.18 |
| 66  | 300075 | 数字政通   | 900   | 23,085.00 | 0.18 |
| 67  | 300010 | 立思辰    | 1,100 | 23,078.00 | 0.18 |
| 68  | 300136 | 信维通信   | 1,100 | 23,056.00 | 0.18 |
| 69  | 300170 | 汉得信息   | 1,500 | 22,770.00 | 0.18 |
| 70  | 300295 | 三六五网   | 700   | 22,750.00 | 0.18 |
| 71  | 300115 | 长盈精密   | 1,100 | 22,660.00 | 0.18 |
| 72  | 300090 | 盛运环保   | 2,800 | 22,652.00 | 0.18 |
| 73  | 300026 | 红日药业   | 1,300 | 22,607.00 | 0.18 |
| 74  | 300336 | 新文化    | 900   | 22,482.00 | 0.17 |
| 75  | 300144 | 宋城演艺   | 900   | 22,419.00 | 0.17 |
| 76  | 300039 | 上海凯宝   | 2,200 | 22,374.00 | 0.17 |
| 77  | 300367 | 东方网力   | 900   | 22,347.00 | 0.17 |
| 78  | 300088 | 长信科技   | 1,500 | 22,305.00 | 0.17 |
| 79  | 300079 | 数码视讯   | 2,600 | 22,282.00 | 0.17 |
| 80  | 300205 | 天喻信息   | 1,500 | 22,185.00 | 0.17 |
| 80  | 300137 | 先河环保   | 1,500 | 22,185.00 | 0.17 |
| 81  | 300005 | 探路者    | 1,300 | 22,165.00 | 0.17 |
| 82  | 300216 | 千山药机   | 700   | 22,141.00 | 0.17 |
| 83  | 300228 | 富瑞特装   | 1,300 | 22,100.00 | 0.17 |
| 84  | 300274 | 阳光电源   | 900   | 21,960.00 | 0.17 |
| 85  | 300238 | 冠昊生物   | 500   | 21,940.00 | 0.17 |
| 86  | 300202 | 聚龙股份   | 900   | 21,789.00 | 0.17 |
| 87  | 300077 | 国民技术   | 1,100 | 21,780.00 | 0.17 |
| 88  | 300004 | 南风股份   | 1,100 | 21,560.00 | 0.17 |
| 89  | 300212 | 易华录    | 700   | 20,839.00 | 0.16 |
| 90  | 300068 | 南都电源   | 900   | 19,674.00 | 0.15 |
| 91  | 300157 | 恒泰艾普   | 1,800 | 19,422.00 | 0.15 |
| 92  | 300052 | 中青宝    | 800   | 17,624.00 | 0.14 |
| 93  | 300166 | 东方国信   | 600   | 16,482.00 | 0.13 |
| 94  | 002415 | 海康威视   | 700   | 15,022.00 | 0.12 |
| 95  | 000063 | 中兴通讯   | 900   | 12,906.00 | 0.10 |
| 96  | 000100 | TCL 集团 | 3,800 | 12,502.00 | 0.10 |
| 97  | 000625 | 长安汽车   | 900   | 12,303.00 | 0.10 |
| 98  | 002292 | 奥飞娱乐   | 400   | 11,980.00 | 0.09 |
| 99  | 000333 | 美的集团   | 500   | 11,860.00 | 0.09 |
| 100 | 000338 | 潍柴动力   | 1,400 | 10,934.00 | 0.08 |

|     |        |        |       |           |      |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 101 | 002202 | 金风科技   | 700   | 10,591.00 | 0.08 |
| 102 | 002236 | 大华股份   | 800   | 10,480.00 | 0.08 |
| 103 | 000001 | 平安银行   | 1,200 | 10,440.00 | 0.08 |
| 104 | 000623 | 吉林敖东   | 400   | 9,980.00  | 0.08 |
| 105 | 000039 | 中集集团   | 700   | 9,919.00  | 0.08 |
| 106 | 000858 | 五粮液    | 300   | 9,759.00  | 0.08 |
| 107 | 002036 | 联创电子   | 400   | 9,364.00  | 0.07 |
| 108 | 000778 | 新兴铸管   | 2,000 | 9,280.00  | 0.07 |
| 109 | 601390 | 中国中铁   | 1,300 | 9,061.00  | 0.07 |
| 110 | 000725 | 京东方A   | 3,900 | 9,009.00  | 0.07 |
| 111 | 002329 | 皇氏集团   | 600   | 8,994.00  | 0.07 |
| 112 | 600150 | 中国船舶   | 400   | 8,904.00  | 0.07 |
| 113 | 600585 | 海螺水泥   | 600   | 8,724.00  | 0.07 |
| 114 | 600315 | 上海家化   | 300   | 8,652.00  | 0.07 |
| 115 | 600783 | 鲁信创投   | 400   | 8,644.00  | 0.07 |
| 116 | 002501 | 利源精制   | 800   | 8,640.00  | 0.07 |
| 117 | 601668 | 中国建筑   | 1,600 | 8,512.00  | 0.07 |
| 118 | 601998 | 中信银行   | 1,500 | 8,505.00  | 0.07 |
| 119 | 601788 | 光大证券   | 500   | 8,470.00  | 0.07 |
| 120 | 002626 | 金达威    | 500   | 8,425.00  | 0.07 |
| 121 | 601800 | XD 中国交 | 800   | 8,424.00  | 0.07 |
| 122 | 600741 | 华域汽车   | 600   | 8,406.00  | 0.07 |
| 123 | 000776 | 广发证券   | 500   | 8,380.00  | 0.07 |
| 124 | 601727 | 上海电气   | 1,100 | 8,316.00  | 0.06 |
| 125 | 600038 | 中直股份   | 200   | 8,296.00  | 0.06 |
| 126 | 600626 | XD 申达股 | 800   | 8,256.00  | 0.06 |
| 127 | 601766 | 中国中车   | 900   | 8,253.00  | 0.06 |
| 128 | 002104 | 恒宝股份   | 500   | 8,220.00  | 0.06 |
| 129 | 600422 | 昆药集团   | 600   | 8,184.00  | 0.06 |
| 130 | 600500 | 中化国际   | 900   | 8,136.00  | 0.06 |
| 131 | 601618 | 中国中冶   | 2,200 | 8,118.00  | 0.06 |
| 132 | 600104 | 上汽集团   | 400   | 8,116.00  | 0.06 |
| 133 | 002560 | 通达股份   | 700   | 8,113.00  | 0.06 |
| 134 | 600582 | 天地科技   | 1,800 | 8,100.00  | 0.06 |
| 135 | 600362 | 江西铜业   | 600   | 8,088.00  | 0.06 |
| 136 | 002130 | 沃尔核材   | 500   | 8,040.00  | 0.06 |
| 137 | 600031 | 三一重工   | 1,600 | 8,032.00  | 0.06 |
| 138 | 002233 | 塔牌集团   | 1,000 | 8,030.00  | 0.06 |
| 139 | 600240 | 华业资本   | 800   | 8,016.00  | 0.06 |

|     |        |        |       |          |      |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 140 | 601669 | 中国电建   | 1,400 | 7,994.00 | 0.06 |
| 141 | 600594 | 益佰制药   | 500   | 7,990.00 | 0.06 |
| 142 | 601717 | 郑煤机    | 1,400 | 7,980.00 | 0.06 |
| 143 | 601186 | 中国铁建   | 800   | 7,968.00 | 0.06 |
| 144 | 600020 | 中原高速   | 1,800 | 7,956.00 | 0.06 |
| 145 | 600291 | 西水股份   | 400   | 7,948.00 | 0.06 |
| 146 | 002416 | 爱施德    | 400   | 7,944.00 | 0.06 |
| 147 | 000488 | 晨鸣纸业   | 1,000 | 7,940.00 | 0.06 |
| 148 | 600688 | 上海石化   | 1,300 | 7,930.00 | 0.06 |
| 149 | 600426 | 华鲁恒升   | 900   | 7,929.00 | 0.06 |
| 150 | 600027 | 华电国际   | 1,600 | 7,920.00 | 0.06 |
| 150 | 601018 | 宁波港    | 1,600 | 7,920.00 | 0.06 |
| 151 | 601600 | 中国铝业   | 2,100 | 7,917.00 | 0.06 |
| 152 | 000511 | *ST 烯碳 | 887   | 7,912.04 | 0.06 |
| 153 | 600015 | 华夏银行   | 800   | 7,912.00 | 0.06 |
| 154 | 000703 | 恒逸石化   | 800   | 7,896.00 | 0.06 |
| 155 | 000807 | 云铝股份   | 1,200 | 7,860.00 | 0.06 |
| 156 | 600875 | 东方电气   | 800   | 7,856.00 | 0.06 |
| 157 | 000961 | 中南建设   | 1,400 | 7,854.00 | 0.06 |
| 158 | 600297 | 广汇汽车   | 900   | 7,839.00 | 0.06 |
| 159 | 002437 | 誉衡药业   | 900   | 7,830.00 | 0.06 |
| 160 | 000652 | 泰达股份   | 1,700 | 7,820.00 | 0.06 |
| 161 | 000718 | 苏宁环球   | 789   | 7,818.99 | 0.06 |
| 162 | 000547 | 航天发展   | 509   | 7,818.24 | 0.06 |
| 163 | 002078 | 太阳纸业   | 1,600 | 7,808.00 | 0.06 |
| 164 | 600978 | 宜华生活   | 700   | 7,798.00 | 0.06 |
| 165 | 000561 | 烽火电子   | 700   | 7,784.00 | 0.06 |
| 165 | 002228 | 合兴包装   | 1,400 | 7,784.00 | 0.06 |
| 166 | 600048 | 保利地产   | 900   | 7,767.00 | 0.06 |
| 167 | 601117 | 中国化学   | 1,400 | 7,742.00 | 0.06 |
| 168 | 002019 | 亿帆鑫富   | 500   | 7,690.00 | 0.06 |
| 169 | 002197 | 证通电子   | 400   | 7,688.00 | 0.06 |
| 170 | 600835 | 上海机电   | 400   | 7,676.00 | 0.06 |
| 171 | 600089 | 特变电工   | 900   | 7,668.00 | 0.06 |
| 172 | 000027 | 深圳能源   | 1,200 | 7,656.00 | 0.06 |
| 173 | 601718 | 际华集团   | 1,000 | 7,640.00 | 0.06 |
| 174 | 600050 | XD 中国联 | 2,000 | 7,620.00 | 0.06 |
| 175 | 002496 | 辉丰股份   | 1,300 | 7,605.00 | 0.06 |
| 176 | 002024 | 苏宁云商   | 700   | 7,602.00 | 0.06 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 177 | 002018 | 华信国际 | 800 | 7,600.00 | 0.06 |
| 178 | 601633 | 长城汽车 | 900 | 7,596.00 | 0.06 |
| 179 | 600704 | 物产中大 | 800 | 7,488.00 | 0.06 |
| 180 | 600100 | 同方股份 | 500 | 7,480.00 | 0.06 |
| 181 | 002465 | 海格通信 | 600 | 7,464.00 | 0.06 |
| 182 | 600395 | 盘江股份 | 900 | 7,434.00 | 0.06 |
| 183 | 600183 | 生益科技 | 800 | 7,416.00 | 0.06 |
| 184 | 002602 | 世纪华通 | 400 | 7,412.00 | 0.06 |
| 185 | 600987 | 航民股份 | 600 | 7,272.00 | 0.06 |
| 186 | 002504 | 弘高创意 | 300 | 7,260.00 | 0.06 |
| 187 | 600827 | 百联股份 | 600 | 7,248.00 | 0.06 |
| 188 | 601607 | 上海医药 | 400 | 7,220.00 | 0.06 |
| 189 | 002304 | 洋河股份 | 100 | 7,192.00 | 0.06 |
| 190 | 600271 | 航天信息 | 300 | 7,140.00 | 0.06 |
| 191 | 600129 | 太极集团 | 400 | 7,084.00 | 0.06 |
| 192 | 600053 | 九鼎投资 | 200 | 6,926.00 | 0.05 |
| 193 | 002450 | 康得新  | 400 | 6,840.00 | 0.05 |
| 194 | 600894 | 广日股份 | 500 | 6,665.00 | 0.05 |
| 195 | 000538 | 云南白药 | 100 | 6,430.00 | 0.05 |
| 196 | 002751 | 易尚展示 | 100 | 6,401.00 | 0.05 |
| 197 | 002594 | 比亚迪  | 100 | 6,101.00 | 0.05 |
| 198 | 002668 | 奥马电器 | 100 | 6,087.00 | 0.05 |
| 199 | 300152 | 科融环境 | 800 | 6,032.00 | 0.05 |
| 200 | 600511 | 国药股份 | 212 | 5,813.04 | 0.05 |
| 201 | 000783 | 长江证券 | 500 | 5,800.00 | 0.05 |
| 202 | 600850 | 华东电脑 | 200 | 5,738.00 | 0.04 |
| 203 | 002190 | 成飞集成 | 153 | 5,422.32 | 0.04 |
| 204 | 000423 | 东阿阿胶 | 100 | 5,283.00 | 0.04 |
| 205 | 300168 | 万达信息 | 200 | 5,198.00 | 0.04 |
| 206 | 002736 | 国信证券 | 300 | 5,175.00 | 0.04 |
| 207 | 002673 | 西部证券 | 200 | 5,172.00 | 0.04 |
| 208 | 600614 | 鼎立股份 | 626 | 5,095.64 | 0.04 |
| 209 | 600120 | 浙江东方 | 225 | 4,884.75 | 0.04 |
| 210 | 000975 | 银泰资源 | 317 | 4,755.00 | 0.04 |
| 211 | 002142 | 宁波银行 | 300 | 4,434.00 | 0.03 |
| 212 | 000401 | 冀东水泥 | 403 | 4,392.70 | 0.03 |
| 213 | 001979 | 招商蛇口 | 300 | 4,275.00 | 0.03 |
| 214 | 000166 | 申万宏源 | 500 | 4,205.00 | 0.03 |
| 215 | 000895 | 双汇发展 | 200 | 4,176.00 | 0.03 |

|     |        |       |       |          |      |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 216 | 000693 | ST 华泽 | 332   | 4,150.00 | 0.03 |
| 217 | 000503 | 海虹控股  | 100   | 4,021.00 | 0.03 |
| 218 | 000768 | 中航飞机  | 200   | 3,938.00 | 0.03 |
| 219 | 000402 | 金融街   | 400   | 3,888.00 | 0.03 |
| 220 | 000636 | 风华高科  | 421   | 3,721.64 | 0.03 |
| 221 | 002500 | 山西证券  | 200   | 3,312.00 | 0.03 |
| 222 | 000917 | 电广传媒  | 200   | 3,306.00 | 0.03 |
| 223 | 002230 | 科大讯飞  | 100   | 3,285.00 | 0.03 |
| 224 | 000069 | 华侨城 A | 500   | 3,200.00 | 0.02 |
| 225 | 000559 | 万向钱潮  | 200   | 3,120.00 | 0.02 |
| 226 | 000826 | 启迪桑德  | 100   | 3,055.00 | 0.02 |
| 227 | 000568 | 泸州老窖  | 100   | 2,970.00 | 0.02 |
| 228 | 000793 | 华闻传媒  | 300   | 2,964.00 | 0.02 |
| 229 | 002456 | 欧菲光   | 100   | 2,950.00 | 0.02 |
| 230 | 000157 | 中联重科  | 700   | 2,891.00 | 0.02 |
| 231 | 002241 | 歌尔股份  | 100   | 2,868.00 | 0.02 |
| 232 | 002030 | 达安基因  | 100   | 2,780.00 | 0.02 |
| 233 | 000009 | 中国宝安  | 200   | 2,740.00 | 0.02 |
| 234 | 000738 | 中航动控  | 100   | 2,640.00 | 0.02 |
| 235 | 600640 | 号百控股  | 157   | 2,636.03 | 0.02 |
| 236 | 000413 | 东旭光电  | 300   | 2,577.00 | 0.02 |
| 237 | 000630 | 铜陵有色  | 1,000 | 2,540.00 | 0.02 |
| 238 | 000876 | 新希望   | 300   | 2,496.00 | 0.02 |
| 239 | 000540 | 中天城投  | 400   | 2,492.00 | 0.02 |
| 240 | 002405 | 四维图新  | 100   | 2,460.00 | 0.02 |
| 241 | 000061 | 农产品   | 200   | 2,432.00 | 0.02 |
| 242 | 002385 | 大北农   | 300   | 2,418.00 | 0.02 |
| 243 | 000977 | 浪潮信息  | 100   | 2,345.00 | 0.02 |
| 244 | 002008 | 大族激光  | 100   | 2,284.00 | 0.02 |
| 245 | 000750 | 国海证券  | 300   | 2,217.00 | 0.02 |
| 246 | 000425 | 徐工机械  | 700   | 2,142.00 | 0.02 |
| 247 | 000792 | 盐湖股份  | 100   | 2,110.00 | 0.02 |
| 248 | 000060 | 中金岭南  | 200   | 2,086.00 | 0.02 |
| 249 | 000712 | 锦龙股份  | 100   | 2,076.00 | 0.02 |
| 250 | 000046 | 泛海控股  | 200   | 2,022.00 | 0.02 |
| 251 | 000581 | 威孚高科  | 100   | 2,016.00 | 0.02 |
| 252 | 002081 | 金螳螂   | 200   | 2,004.00 | 0.02 |
| 253 | 002276 | 万马股份  | 100   | 1,981.00 | 0.02 |
| 254 | 002475 | 立讯精密  | 100   | 1,965.00 | 0.02 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 255 | 000709 | 河钢股份 | 700 | 1,939.00 | 0.02 |
| 256 | 002353 | 杰瑞股份 | 100 | 1,928.00 | 0.01 |
| 257 | 000031 | 中粮地产 | 200 | 1,886.00 | 0.01 |
| 258 | 000598 | 兴蓉环境 | 300 | 1,584.00 | 0.01 |
| 259 | 000970 | 中科三环 | 100 | 1,451.00 | 0.01 |
| 260 | 000883 | 湖北能源 | 300 | 1,389.00 | 0.01 |
| 261 | 002146 | 荣盛发展 | 200 | 1,344.00 | 0.01 |
| 262 | 000825 | 太钢不锈 | 400 | 1,264.00 | 0.01 |
| 263 | 000800 | 一汽轿车 | 100 | 1,088.00 | 0.01 |
| 264 | 002663 | 普邦园林 | 136 | 1,000.96 | 0.01 |
| 265 | 000582 | 北部湾港 | 53  | 864.96   | 0.01 |

## 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末基金资产净值 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   | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|------------|-----------------|
| 1  | 300059 | 东方财富   | 170,038.60 | 1.32            |
| 2  | 300207 | 欣旺达    | 130,579.00 | 1.01            |
| 3  | 300090 | 盛运环保   | 129,066.58 | 1.00            |
| 4  | 300183 | 东软载波   | 124,104.00 | 0.96            |
| 5  | 002415 | 海康威视   | 120,987.00 | 0.94            |
| 6  | 300104 | 乐视网    | 114,698.00 | 0.89            |
| 7  | 300002 | 神州泰岳   | 112,091.00 | 0.87            |
| 8  | 000063 | 中兴通讯   | 108,437.00 | 0.84            |
| 9  | 300017 | 网宿科技   | 108,062.00 | 0.84            |
| 10 | 000100 | TCL 集团 | 107,591.00 | 0.84            |
| 11 | 300039 | 上海凯宝   | 107,555.00 | 0.84            |
| 12 | 300147 | 香雪制药   | 107,234.00 | 0.83            |
| 13 | 601800 | 中国交建   | 105,949.00 | 0.82            |
| 14 | 601390 | 中国中铁   | 105,537.00 | 0.82            |
| 15 | 601186 | 中国铁建   | 105,011.99 | 0.82            |
| 16 | 601668 | 中国建筑   | 104,919.00 | 0.82            |
| 17 | 600050 | 中国联通   | 104,885.00 | 0.82            |
| 18 | 600150 | 中国船舶   | 104,155.00 | 0.81            |
| 19 | 601998 | 中信银行   | 104,028.00 | 0.81            |

|    |        |     |            |      |
|----|--------|-----|------------|------|
| 20 | 300336 | 新文化 | 102,886.00 | 0.80 |
|----|--------|-----|------------|------|

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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   | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|------------|-----------------|
| 1  | 300059 | 东方财富   | 140,949.00 | 1.10            |
| 2  | 300183 | 东软载波   | 124,433.00 | 0.97            |
| 3  | 300207 | 欣旺达    | 111,170.93 | 0.86            |
| 4  | 300090 | 盛运环保   | 104,939.00 | 0.82            |
| 5  | 002415 | 海康威视   | 104,402.00 | 0.81            |
| 6  | 600958 | 东方证券   | 98,968.00  | 0.77            |
| 7  | 300147 | 香雪制药   | 95,584.57  | 0.74            |
| 8  | 601998 | 中信银行   | 95,193.00  | 0.74            |
| 9  | 600050 | 中国联通   | 94,946.00  | 0.74            |
| 10 | 601668 | 中国建筑   | 94,879.00  | 0.74            |
| 11 | 000063 | 中兴通讯   | 94,447.00  | 0.73            |
| 12 | 600150 | 中国船舶   | 93,834.00  | 0.73            |
| 13 | 601800 | 中国交建   | 93,426.00  | 0.73            |
| 14 | 601186 | 中国铁建   | 93,121.00  | 0.72            |
| 15 | 000100 | TCL 集团 | 92,971.00  | 0.72            |
| 16 | 300002 | 神州泰岳   | 92,686.00  | 0.72            |
| 17 | 601390 | 中国中铁   | 91,693.00  | 0.71            |
| 18 | 002018 | 华信国际   | 88,545.50  | 0.69            |
| 19 | 300039 | 上海凯宝   | 87,591.54  | 0.68            |
| 20 | 000157 | 中联重科   | 84,956.00  | 0.66            |

#### 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 | 18,823,395.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 18,470,284.60 |

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 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  |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 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。

### 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持有股指期货。

### 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。

**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 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 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 |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 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     |

### 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(转型前)

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
|-------|----------|------|------------|---------------|------------|
| 1,388 | 7,930.31 | -    | -          | 11,007,264.31 | 100.00%    |

## 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 | 325.67    | 0.00%    |

## 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

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。

# § 8 基金份额持有人信息(转型后)

## 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 1,253        | 8,220.51      | -     | -          | 10,300,305.10 | 100.00%    |

## 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 | 325.67    | 0.00%    |

## 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

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。

## § 9 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                          | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                | -             |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额              | 706,959.21    |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 ( 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                 | 11,717,799.09 |
| 报告期期间基金总申购份额                | 12,855,743.66 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额              | 13,566,278.44 |
| 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 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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”。

## 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

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的投资策略未发生变更；

报告期内（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日），银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金的投资策略未发生变更。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

## 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

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

### 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          |              | 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 |            |
| 华泰证券股份有限公司 | 5      | 10,915,726.85 | 29.27%       | 10,165.98 | 30.42%     | 新增 2 个交易单元 |
| 东吴证券股份有限公司 | 3      | 6,546,879.21  | 17.56%       | 4,787.57  | 14.33%     | -          |
| 广发证券股份有限公司 | 2      | 6,216,248.60  | 16.67%       | 5,789.22  | 17.32%     | -          |

|                        |   |              |        |          |        |                |
|------------------------|---|--------------|--------|----------|--------|----------------|
| 国金证券股份<br>有限公司         | 2 | 3,871,339.14 | 10.38% | 3,605.49 | 10.79% | -              |
| 长江证券股份<br>有限公司         | 2 | 2,866,516.70 | 7.69%  | 2,669.65 | 7.99%  | -              |
| 上海华信证券<br>有限责任公司       | 1 | 2,035,022.80 | 5.46%  | 1,895.15 | 5.67%  | -              |
| 中国中投证券<br>有限责任公司       | 1 | 1,761,598.96 | 4.72%  | 1,640.60 | 4.91%  | -              |
| 方正证券股份<br>有限公司         | 5 | 1,469,381.76 | 3.94%  | 1,368.56 | 4.10%  | -              |
| 中信证券股份<br>有限公司         | 3 | 1,341,897.71 | 3.60%  | 1,249.71 | 3.74%  | -              |
| 光大证券股份<br>有限公司         | 2 | 265,140.00   | 0.71%  | 247.01   | 0.74%  | -              |
| 湘财证券有限<br>责任公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 渤海证券股份<br>有限公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 国信证券股份<br>有限公司         | 3 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 中信建投证券<br>股份有限公司       | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 江海证券有限<br>公司           | 2 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 东莞证券有限<br>责任公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 招商证券股份<br>有限公司         | 2 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 日信证券有限<br>责任公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 平安证券有限<br>责任公司         | 2 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 长城证券有限<br>责任公司         | 3 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 第一创业证券<br>股份有限公司       | 2 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 华福证券有限<br>责任公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 中信证券（山<br>东）有限责任公<br>司 | 1 | -            | -      | -        | -      | -              |
| 红塔证券股份<br>有限公司         | 1 | -            | -      | -        | -      | 撤销 1 个交<br>易单元 |

|                  |   |   |   |   |   |                |
|------------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 东北证券股份<br>有限公司   | 4 | - | - | - | - | 新增 1 个交<br>易单元 |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | -              |
| 瑞银证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 民生证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 上海证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 首创证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 华创证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 中原证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 西部证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 中国国际金融<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 华融证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 新时代证券有<br>限责任公司  | 2 | - | - | - | - | -              |
| 兴业证券股份<br>有限公司   | 3 | - | - | - | - | -              |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 华宝证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 安信证券股份<br>有限公司   | 3 | - | - | - | - | -              |
| 西南证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 东方证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 国都证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 太平洋证券股           | 2 | - | - | - | - | -              |

|                  |   |   |   |   |   |                |
|------------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 份有限公司            |   |   |   |   |   |                |
| 广州证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 华安证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 海通证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 德邦证券有限<br>责任公司   | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交<br>易单元 |
| 中国民族证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | -              |
| 申万宏源集团<br>股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | -              |
| 中泰证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |

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等。

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。

3、本基金合同生效日为 2016 年 4 月 25 日。

### 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         |                      | 债券回购交易        |                            | 权证交易 |                      |
|----------------|--------------|----------------------|---------------|----------------------------|------|----------------------|
|                | 成交金额         | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额          | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 华泰证券股份<br>有限公司 | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |
| 东吴证券股份<br>有限公司 | 1,519,500.00 | 14.79%               | -             | -                          | -    | -                    |
| 广发证券股份<br>有限公司 | 3,360,478.60 | 32.71%               | 1,600,000.00  | 5.18%                      | -    | -                    |
| 国金证券股份<br>有限公司 | 900,000.00   | 8.76%                | 14,600,000.00 | 47.25%                     | -    | -                    |
| 长江证券股份<br>有限公司 | -            | -                    | -             | -                          | -    | -                    |

|                        |              |        |               |        |   |   |
|------------------------|--------------|--------|---------------|--------|---|---|
| 上海华信证券<br>有限责任公司       | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 中国中投证券<br>有限责任公司       | -            | -      | 14,700,000.00 | 47.57% | - | - |
| 方正证券股份<br>有限公司         | 3,893,002.00 | 37.90% | -             | -      | - | - |
| 中信证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 光大证券股份<br>有限公司         | 599,880.00   | 5.84%  | -             | -      | - | - |
| 湘财证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 渤海证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 国信证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 中信建投证券<br>股份有限公司       | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 江海证券有限<br>公司           | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 东莞证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 招商证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 日信证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 平安证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 长城证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 第一创业证券<br>股份有限公司       | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 华福证券有限<br>责任公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 中信证券（山<br>东）有限责任公<br>司 | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 红塔证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 东北证券股份<br>有限公司         | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 中银国际证券<br>有限责任公司       | -            | -      | -             | -      | - | - |
| 瑞银证券有限                 | -            | -      | -             | -      | - | - |

|                  |  |  |  |  |  |  |
|------------------|--|--|--|--|--|--|
| 责任公司             |  |  |  |  |  |  |
| 民生证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 上海证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 首创证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 华创证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中原证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 西部证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 东兴证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中国国际金融<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 华融证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 新时代证券有<br>限责任公司  |  |  |  |  |  |  |
| 兴业证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 |  |  |  |  |  |  |
| 华宝证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 安信证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 西南证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 东方证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 国都证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 太平洋证券股<br>份有限公司  |  |  |  |  |  |  |
| 广州证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 华安证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 海通证券股份           |  |  |  |  |  |  |

|                  |  |  |  |  |  |  |
|------------------|--|--|--|--|--|--|
| 有限公司             |  |  |  |  |  |  |
| 德邦证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中国民族证券<br>有限责任公司 |  |  |  |  |  |  |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 申万宏源集团<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中泰证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

#### 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |                |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | 5          | 39,157.74 | 83.34%               | 36.47     | 83.34%         | 新增 2 个交<br>易单元 |
| 国金证券股份<br>有限公司   | 2          | 7,827.18  | 16.66%               | 7.29      | 16.66%         | -              |
| 上海证券有限<br>责任公司   | 1          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 首创证券有限<br>责任公司   | 2          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 华融证券股份<br>有限公司   | 1          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 东北证券股份<br>有限公司   | 4          | -         | -                    | -         | -              | 新增 1 个交<br>易单元 |
| 第一创业证券<br>股份有限公司 | 2          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 中原证券股份<br>有限公司   | 2          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 中泰证券股份<br>有限公司   | 1          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 东莞证券有限<br>责任公司   | 1          | -         | -                    | -         | -              | -              |
| 华福证券有限<br>责任公司   | 1          | -         | -                    | -         | -              | -              |

|                |   |   |   |   |   |             |
|----------------|---|---|---|---|---|-------------|
| 中信证券（山东）有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -           |
| 广发证券股份有限公司     | 2 | - | - | - | - | -           |
| 兴业证券股份有限公司     | 3 | - | - | - | - | -           |
| 民生证券有限责任公司     | 2 | - | - | - | - | -           |
| 长城证券有限责任公司     | 3 | - | - | - | - | -           |
| 德邦证券有限责任公司     | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易日单元 |
| 华创证券有限责任公司     | 2 | - | - | - | - | -           |
| 新时代证券有限责任公司    | 1 | - | - | - | - | -           |
| 光大证券股份有限公司     | 2 | - | - | - | - | -           |
| 申万宏源集团股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | -           |
| 日信证券有限责任公司     | 1 | - | - | - | - | -           |
| 瑞银证券有限责任公司     | 1 | - | - | - | - | -           |
| 国泰君安证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | -           |
| 华宝证券有限责任公司     | 1 | - | - | - | - | -           |
| 中国银河证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 长江证券股份有限公司     | 2 | - | - | - | - | -           |
| 中信证券股份有限公司     | 3 | - | - | - | - | -           |
| 中信建投证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 湘财证券有限责任公司     | 1 | - | - | - | - | -           |
| 渤海证券股份有限公司     | 1 | - | - | - | - | -           |
| 东方证券股份有限公司     | 2 | - | - | - | - | -           |

|                  |   |   |   |   |   |                |
|------------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 中国民族证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 上海华信证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 国信证券股份<br>有限公司   | 3 | - | - | - | - | -              |
| 西南证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 江海证券有限<br>公司     | 2 | - | - | - | - | -              |
| 西部证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 中国国际金融<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 安信证券股份<br>有限公司   | 3 | - | - | - | - | -              |
| 方正证券股份<br>有限公司   | 5 | - | - | - | - | -              |
| 国都证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 东吴证券股份<br>有限公司   | 3 | - | - | - | - | -              |
| 太平洋证券股<br>份有限公司  | 2 | - | - | - | - | -              |
| 平安证券有限<br>责任公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 广州证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 中国中投证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | -              |
| 海通证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 华安证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | -              |
| 红塔证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | 撤销 1 个交<br>易单元 |
| 招商证券股份<br>有限公司   | 2 | - | - | - | - | -              |
| 中银国际证券           | 2 | - | - | - | - | -              |

|        |  |  |  |  |  |  |
|--------|--|--|--|--|--|--|
| 有限责任公司 |  |  |  |  |  |  |
|--------|--|--|--|--|--|--|

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等。

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 |              | 债券回购交易       |                | 权证交易 |              |
|----------------|------|--------------|--------------|----------------|------|--------------|
|                | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额         | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 国金证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 上海证券有限责任公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 首创证券有限责任公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 华融证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 东北证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 第一创业证券股份有限公司   | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中原证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中泰证券股份有限公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 东莞证券有限责任公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 华福证券有限责任公司     | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | -    | -            | -            | -              | -    | -            |
| 广发证券股份有限公司     | -    | -            | 9,300,000.00 | 16.73%         | -    | -            |

|                  |   |   |               |        |   |   |
|------------------|---|---|---------------|--------|---|---|
| 兴业证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 民生证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 长城证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 德邦证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 华创证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 新时代证券有<br>限责任公司  | - | - | -             | -      | - | - |
| 光大证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 申万宏源集团<br>股份有限公司 | - | - | 1,500,000.00  | 2.70%  | - | - |
| 日信证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 瑞银证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 华宝证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 长江证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 中信证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 中信建投证券<br>股份有限公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 湘财证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 渤海证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 东方证券股份<br>有限公司   | - | - | 20,500,000.00 | 36.87% | - | - |
| 中国民族证券<br>有限责任公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 上海华信证券<br>有限责任公司 | - | - | -             | -      | - | - |

|                  |   |   |               |        |   |   |
|------------------|---|---|---------------|--------|---|---|
| 国信证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 西南证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 江海证券有限<br>公司     | - | - | -             | -      | - | - |
| 西部证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 中国国际金融<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 安信证券股份<br>有限公司   | - | - | 3,600,000.00  | 6.47%  | - | - |
| 方正证券股份<br>有限公司   | - | - | 500,000.00    | 0.90%  | - | - |
| 国都证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 东吴证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 太平洋证券股<br>份有限公司  | - | - | -             | -      | - | - |
| 平安证券有限<br>责任公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 广州证券有限<br>责任公司   | - | - | 17,200,000.00 | 30.94% | - | - |
| 中国中投证券<br>有限责任公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 海通证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 华安证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 红塔证券股份<br>有限公司   | - | - | -             | -      | - | - |
| 招商证券股份<br>有限公司   | - | - | 3,000,000.00  | 5.40%  | - | - |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | - | - | -             | -      | - | - |

### 10.8 其他重大事件（转型后）

| 序号 | 公告事项          | 法定披露方式   | 法定披露日期     |
|----|---------------|----------|------------|
| 1  | 《银华量化智慧动力灵活配置 | 本基金管理人网站 | 2016年4月25日 |

|   |  |                |                 |
|---|--|----------------|-----------------|
|   | 混合型证券投资基金基金合同》   |                |                 |
| 2 | 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金合同摘要》                                  | 本基金管理人网站       | 2016 年 4 月 25 日 |
| 3 | 《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》                                  | 本基金管理人网站       | 2016 年 4 月 25 日 |
| 4 | 《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》                                 | 本基金管理人网站       | 2016 年 4 月 25 日 |
| 5 | 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金开放赎回及转换转出业务的提示性公告》                     | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 27 日 |
| 6 | 《银华基金管理有限公司关于淘宝店业务及网上直销支付宝渠道下线的公告》                           | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 18 日 |
| 7 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民生银行直销银行“基金通”平台费率优惠活动的公告》               | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 26 日 |
| 8 | 《关于瑞银证券不再代销银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 6 月 16 日 |
| 9 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资                                   | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 6 月 16 日 |

|    |   |                     |                 |
|----|---|---------------------|-----------------|
|    | 产管理有限公司开通定投业务的公告》                         |                     |                 |
| 10 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海联泰资产管理网上费率优惠活动的公告》 | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 6 月 17 日 |
| 11 | 《关于开通通联支付渠道网上直销定期定额申购业务的公告》               | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 6 月 17 日 |

### 10.8 其他重大事件（转型前）

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式         | 法定披露日期         |
|----|---|----------------|----------------|
| 1  | 《银华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值公告》                       | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 1 月 4 日 |
| 2  | 《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 4 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 1 月 5 日 |
| 3  | 《银华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告》                 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 1 月 6 日 |
| 4  | 《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）          | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 1 月 6 日 |
| 5  | 《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）        | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 1 月 6 日 |

|    |   |                     |                 |
|----|---|---------------------|-----------------|
| 6  | 《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 7 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》 | 本基金管理人网站            | 2016 年 1 月 7 日  |
| 7  | 《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》              | 三大证券报及本基金管理人网站      | 2016 年 1 月 22 日 |
| 8  | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的视觉中国、胜利精密估值方法调整的公告》                 | 三大证券报及本基金管理人网站      | 2016 年 2 月 4 日  |
| 9  | 《关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》                | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 2 月 24 日 |
| 10 | 《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在平安证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》         | 三大证券报及本基金管理人网站      | 2016 年 2 月 26 日 |
| 11 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中源协和、天银机电估值方法调整的公告》                 | 三大证券报及本基金管理人网站      | 2016 年 3 月 2 日  |
| 12 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券投资咨询有限公司网上费率优惠活动的公告》          | 三大证券报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 15 日 |
| 13 | 《关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金                                | 三大证券报、证券日报及本基金管理人   | 2016 年 3 月 16 日 |

|    |   |                |                 |
|----|---|----------------|-----------------|
|    | 代销机构并参加其费率优惠活动的公告》                              | 网站             |                 |
| 14 | 《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告》              | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 24 日 |
| 15 | 《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 2015 年年度报告》        | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 16 | 《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要》      | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 17 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》 | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 31 日 |
| 18 | 《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销定期定额申购业务费率优惠的公告》      | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 1 日  |
| 19 | 《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在上海证券开通定期定额投资业务的公告》        | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 19 日 |
| 20 | 《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 1 季度报告》    | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 21 日 |
| 21 | 《银华基金管理有限公司关于淘宝店业务及网上直销支付宝渠道下线的公告》              | 三大证券报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 18 日 |

|    |                                       |                     |                 |
|----|---------------------------------------|---------------------|-----------------|
| 22 | 《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告》 | 三大证券报及本基金经理人网站      | 2016 年 6 月 14 日 |
| 23 | 《关于开通通联支付渠道网上直销定期定额申购业务的公告》           | 三大证券报、证券日报及本基金经理人网站 | 2016 年 6 月 17 日 |

## § 11 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”。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 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

12.1.2 《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》

12.1.3 《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》

12.1.4 《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》

12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 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。

### 12.3 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8月24日