

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 指数证券投资基金转型)

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金管理人于 2016 年 3 月 28 日至 2016 年 4 月 15 日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 20 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表决结果的公告》。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，并由基金管理人报中国证监会备案。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，同时本基金更名为“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力义务关系以《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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 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）。

§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 | 银华基金管理股份有限公司 |
| 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 | 银华基金管理股份有限公司 |
| 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 | 72,320,067.59 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。 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 \times 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。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。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> <p>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%。</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 | | 银华基金管理股份有限公司 | 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 |

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016年1月1日-2016年12月31日） | | 2015年 | 2014年 |
|---------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------|--------------|
| | 转型前 （2016年1月1日-2016年4月24日） | 转型后 （2016年4月25日-2016年12月31日） | | |
| 本期已实现收益 | -70,771.86 | 864,774.36 | 5,921,581.99 | 6,475,388.83 |
| 本期利润 | -963,655.08 | -1,988,130.20 | 4,240,318.62 | 9,635,546.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0818 | -0.0730 | 0.2367 | 0.1530 |
| 本期加权平均净值利润率 | -6.43% | -5.72% | 17.85% | 14.58% |
| 本期基金份额净值增长率 | -5.93% | -1.97% | 13.94% | 17.69% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 | | 2015年末 | 2014年末 |
| | 转型前 （2016年4月24日） | 转型后 （2016年12月31日） | | |
| 期末可供分配利润 | 2,956,206.26 | 14,713,251.41 | 5,627,508.81 | 1,865,842.58 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2686 | 0.2034 | 0.4803 | 0.0790 |

| | | | | |
|---------------------|--------------------------|---------------------------|---------------|---------------|
| 期末基金资产净值 | 13,963,470.57 | 89,989,525.26 | 15,809,561.61 | 27,959,232.34 |
| 期末基金份额净值 | 1.269 | 1.244 | 1.349 | 1.184 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 | | 2015 年末 | 2014 年末 |
| | 转型前 (2016 年 4 月 24 日) | 转型后 (2016 年 12 月 31 日) | | |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.90% | -1.97% | 34.90% | 18.40% |

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中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。

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

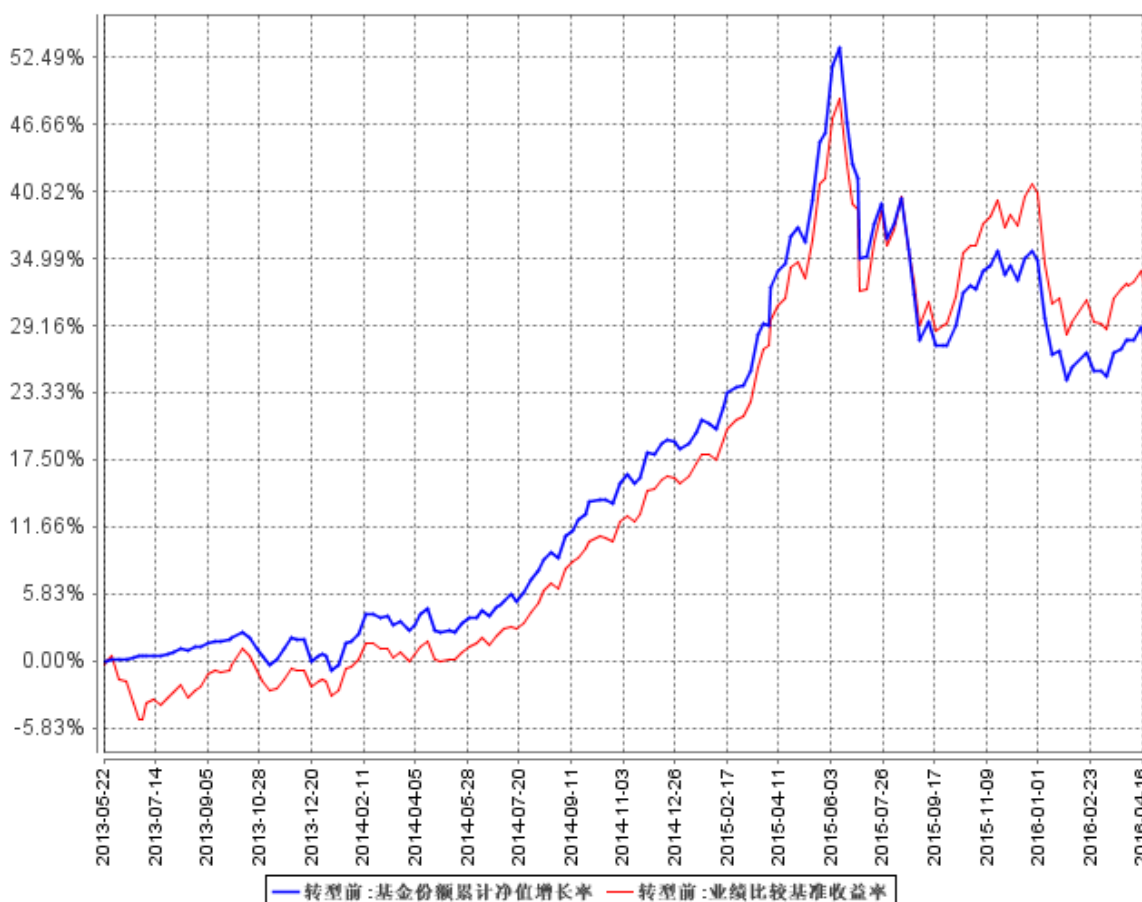
| 阶段 | 转型前 | | | | | ①—③ | ②—④ |
|-----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|-----|
| | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | | | |
| 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 | -5.93% | 0.68% | -6.51% | 0.80% | 0.58% | -0.12% | |
| 2016 年 1 月 25 日至 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 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 | -7.30% | 0.81% | -1.98% | 0.88% | -5.32% | -0.07% | |

| | | | | | | |
|---|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2016 年 4 月 24 日 | | | | | | |
| 自基金合 同生效起 至 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

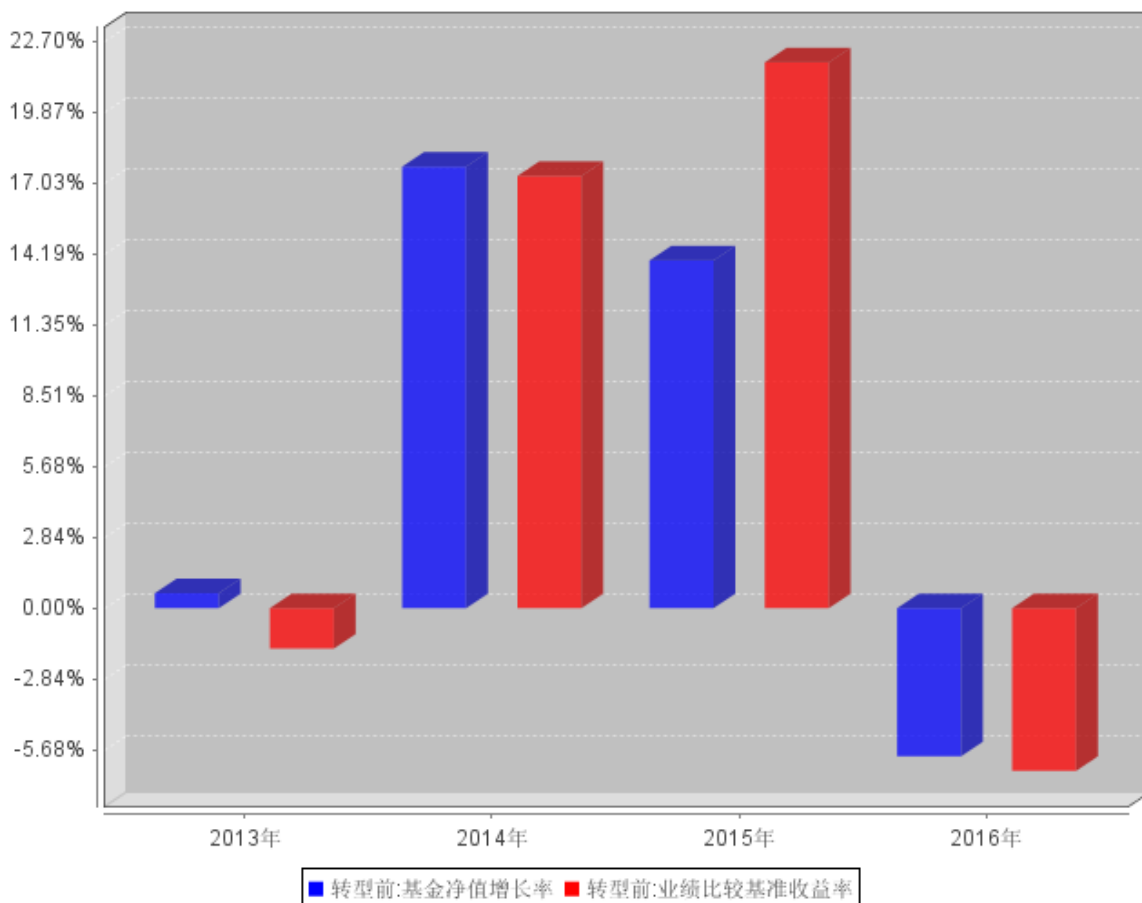


注：按基金合同的规定，本基金（转型前）自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金投资于中证银华成长股债恒定组合 30/70 指数成份证券及其备选成份证券的组合比例不低于基金资产的 90%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资

产净值的 5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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

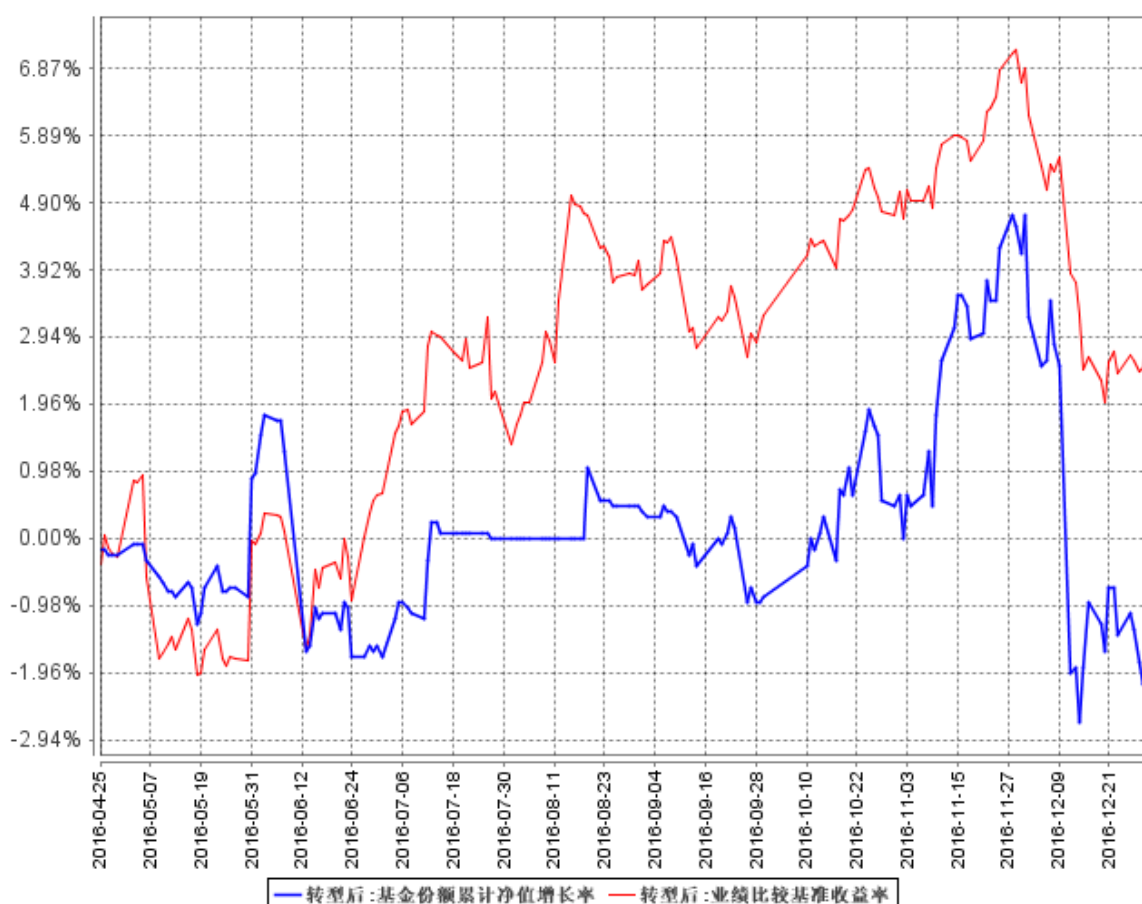
| 转型后 | | | | | | |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
| 过去三个月 | -1.11% | 0.80% | -0.49% | 0.39% | -0.62% | 0.41% |
| 过去六个月 | -0.40% | 0.59% | 2.12% | 0.41% | -2.52% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.97% | 0.58% | 2.76% | 0.46% | -4.73% | 0.12% |

注：本基金的业绩比较基准为：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中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，其选择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。

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

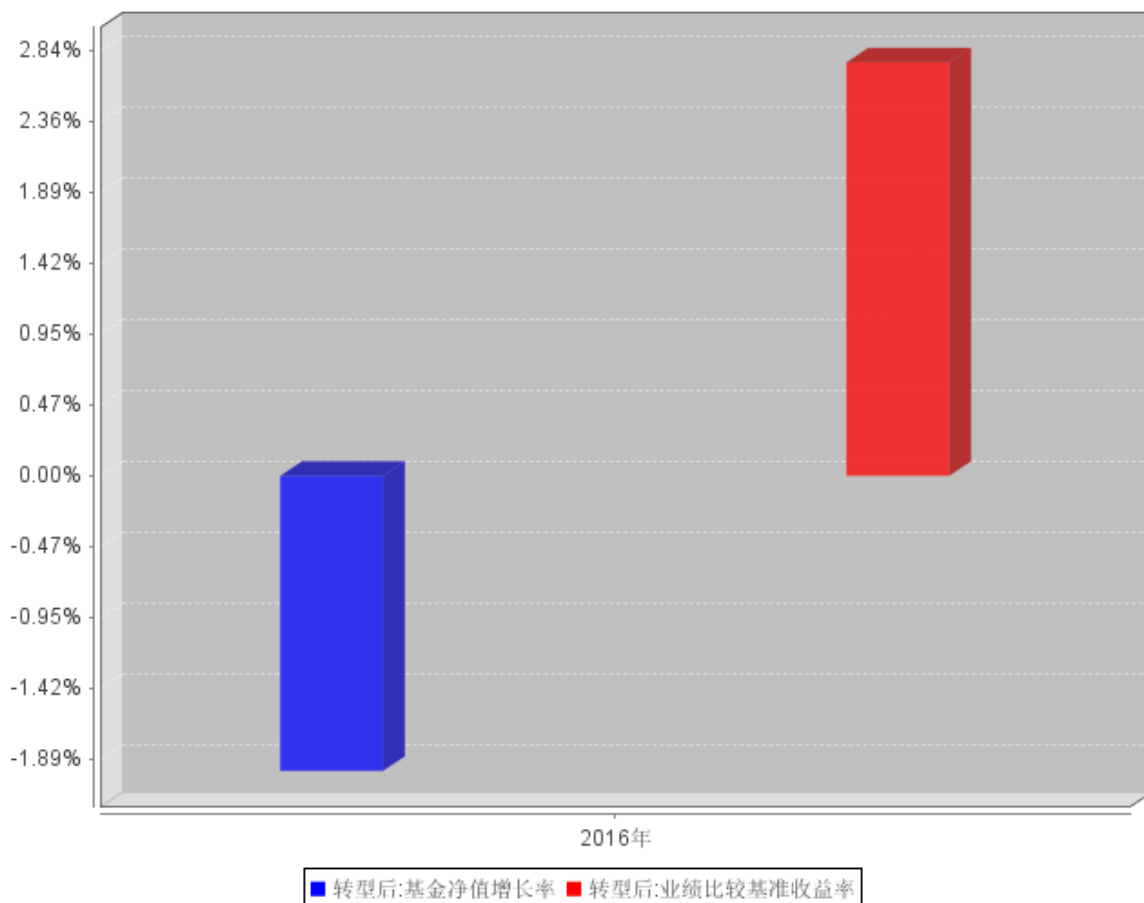
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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%。”

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：本基金于 2016 年度、2015 年度及 2014 年度均未进行利润分配。

转型后

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理

及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 70 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、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、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增

长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选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 24 日 | 8 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 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 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 2016 年 1 月 14 日起兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

| | | | | | |
|-------|----------|-----------------|-----------------|-----|--|
| 葛鹤军先生 | 本基金的基金经理 | 2014 年 10 月 8 日 | 2016 年 4 月 24 日 | 8 年 | 博士学位。2008 年至 2011 年就职于中诚信证券评估有限公司、中诚信国际信用评级有限公司。2011 年 11 月加盟银华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月 8 日起兼任银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华信用债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，自 2015 年 4 月 24 日起兼任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华恒利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月 17 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 5 日起兼任银华通利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 5 日起兼任银华上证 5 年期国债指数证券投资基金和银华上证 10 年期国债指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
|-------|----------|-----------------|-----------------|-----|--|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 | - | 7 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 日起担任银华中证等权重 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人

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

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

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

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人又对上述制度进行了修改完善，进一步修订了公平交易的范围，修订了对不同投资合同日反向交易的监控重点，并强调了本基金管理人内部控制的要求，具体控制方法为：1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现，不掺杂任何的人为判断，所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行，公平交易程序自动启动；2、一般情况下，场外交易指令以组合的名义下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体

系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。

在投资决策环节，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合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

本基金使用量化策略进行资产配置和股票投资，并辅以固定收益投资和股指期货等衍生品进行收益增强。报告期内，本基金策略的绩效表现仍在我们的预期之内。我们将继续勤勉投资，力争获得超越基准指数的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 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 1.244 元，本报告期（2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日）份额净值增长率为 -1.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.76%。

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

过去的一年，A 股市场处于宽幅震荡中。尽管 PPP、金融地产、举牌概念等多种行业主题快速轮动，但仍缺乏能够持续引领市场的投资主线；上半年表现强势的食品饮料、有色金属等板块出现大幅度回调，而近年来强势的 TMT 板块今年以来持续低迷，整个季度市场整体表现偏弱。地产火爆对股市的分流、定向增发及 IPO 对资金的吸引、以及二级市场缺乏持续的赚钱效应，都使得 A 股的吸引力不断下降，成交量也不断萎缩。

展望 2017 年，全球及国内的各方面不确定性因素将逐步落地，资产价格的波动将会加大。供给侧改革、混合所有制改革等受政策驱动的主题和有确定性业绩的公司或存在阶段性的投资机会。在没有明确的投资主线出现之前，我们保持相对谨慎的投资观点。

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

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内（2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 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 7 月 15 日及 2016 年 8 月 19 日至 2016 年 10 月 28 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 审计报告（转型前）

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 2016 年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告（转型后）

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度财务会计报告经安永华明会计师

事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：银华中证成长股债恒定组合 30/70 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 | 本期末 2016 年 4 月 24 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 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 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 3,928.48 | 200,000.00 |
| 应收利息 | 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 | - | - |
| 资产总计 | 15,790,438.22 | 17,216,419.24 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2016 年 4 月 24 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 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 | - | 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 | 216,597.37 | 397,524.29 |
| 负债合计 | 1,826,967.65 | 1,406,857.63 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 11,007,264.31 | 11,717,799.09 |
| 未分配利润 | 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，基金份额总额为 11,007,264.31 份。

（2）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。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”。

7.2 利润表

会计主体：银华中证成长股债恒定组合 30/70 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 | 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 12 月 31 日 |
| 一、收入 | -727,408.12 | 5,248,077.58 |
| 1. 利息收入 | 125,834.90 | 1,009,705.94 |
| 其中：存款利息收入 | 2,536.16 | 26,099.86 |
| 债券利息收入 | 121,995.62 | 962,057.38 |
| 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 | 5,805,087.50 |
| 其中：股票投资收益 | 17,660.65 | 5,246,883.03 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | 524,300.30 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

| | | |
|----------------------------|--------------------|---------------------|
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,408.12 | 33,904.17 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -892,883.22 | -1,681,263.37 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 20,571.43 | 114,547.51 |
| 减：二、费用 | 236,246.96 | 1,007,758.96 |
| 1. 管理人报酬 | 28,349.62 | 142,977.30 |
| 2. 托管费 | 9,449.92 | 47,658.99 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 94.92 | 36,248.69 |
| 5. 利息支出 | 7,655.54 | 195,046.27 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 7,655.54 | 195,046.27 |
| 6. 其他费用 | 190,696.96 | 585,827.71 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -963,655.08 | 4,240,318.62 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -963,655.08 | 4,240,318.62 |

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。

7.3 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 30/70 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 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 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 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） | - | 4,240,318.62 | 4,240,318.62 |
| 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） | -11,899,194.65 | -4,490,794.70 | -16,389,989.35 |
| 其中：1. 基金申购款 | 65,900,746.35 | 18,998,469.49 | 84,899,215.84 |
| 2. 基金赎回款 | -77,799,941.00 | -23,489,264.19 | -101,289,205.19 |
| 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） | 11,717,799.09 | 4,091,762.52 | 15,809,561.61 |

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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 王立新 | 凌宇翔 | 龚飒 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华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，由银华基金管理股份有限公司于 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股份有限公司，注册登记机构为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。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”。

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，基金管理人在履行适当程序后，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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”） | 基金管理人股东 |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 东北证券股份有限公司（“东北证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 山西海鑫实业股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 银华基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 银华财富资本管理（北京）有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 银华国际资本管理有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 深圳银华永泰创新投资有限公司 | 基金管理人子公司的子公司 |

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2016 年 8 月 9 日，银华基金管理有限公司变更名称为银华基金管理股份有限公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | |
|-------|---------------------------------------|----------------------|---|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 西南证券 | - | - | 2,843,622.17 | 13.90% |
| 第一创业 | - | - | 1,580,333.32 | 7.72% |

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | |
|-------|---------------------------------------|----------------------|---|----------------------|
| | 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 成交总额的 比例 |
| 西南证券 | - | - | 12,263,040.00 | 44.84% |
| 第一创业 | - | - | 3,037,500.00 | 11.11% |

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | |
|-------|---------------------------------------|----------------------------|---|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 |
| 东北证券 | - | - | 7,000,000.00 | 1.84% |
| 西南证券 | - | - | 20,200,000.00 | 5.30% |
| 第一创业 | - | - | 7,000,000.00 | 1.84% |

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|----------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付 佣金总额的 比例 |
| 西南证券 | 2,592.25 | 13.91% | 156.38 | 44.29% |
| 第一创业 | 1,438.99 | 7.72% | - | - |

注：本基金于 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止期间无应付关联方的佣金。

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 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12月 31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 28,349.62 | 142,977.30 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 ¹ | 8,327.50 | 47,950.82 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 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

7.4.8.2.2 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12月 31日 |

| | | |
|----------------|----------|-----------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,449.92 | 47,658.99 |
|----------------|----------|-----------|

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年4月24日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|--------|----------------------------|----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 517,223.94 | 2,238.66 | 682,877.99 | 22,771.02 |

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年4月24日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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 | 14.60 | 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 | 29.14 | 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 | 20.20 | 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 | 19.82 | 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 | 17.00 | 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 | 18.67 | 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 | 2017年1月3日 | 16.90 | 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 | 重大事项 | 15.80 | 2016年6月20日 | 14.22 | 354 | 7,366.74 | 5,593.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|------|-------|-------------|-------|-----|----------|----------|---|
| | | 17日 | | | | | | | | |
| 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 | 2016年11月24日 | 16.50 | 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 | 12.95 | 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 | 17.20 | 157 | 2,196.92 | 2,687.84 | - |
| 600640 | 号百控股 | 2016年4月18日 | 重大事项 | 16.79 | 2016年8月22日 | 18.44 | 157 | 3,059.53 | 2,636.03 | - |
| 600468 | 百利电气 | 2016年2月2日 | 重大事项 | 11.47 | 2016年5月19日 | 12.62 | 134 | 1,508.53 | 1,536.98 | - |
| 000582 | 北部湾港 | 2016年2月29日 | 重大事项 | 16.38 | 2016年9月8日 | 17.95 | 53 | 1,595.83 | 868.14 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 4 月 24 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,600,000.00 元，于 2016 年 4 月 25 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金、应付证券清算款等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,922,403.21 元，属于第二层次的余额为人民币 12,088,544.74 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 3,592,208.06 元，第二层次人民币 12,340,947.38 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 242,879.37 元（2015 年度：人民币 557,003.02 元），由第二层次转入第一层次的金额为人民币 388,715.42 元（2015 年度：人民币 404,887.75 元）。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2015 年度：无）。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§7 年度财务报表(转型后)

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 7,998,209.66 |
| 结算备付金 | 923,717.43 |
| 存出保证金 | 32,608.53 |
| 交易性金融资产 | 84,840,079.02 |
| 其中：股票投资 | 84,840,079.02 |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 应收证券清算款 | 35,829.37 |
| 应收利息 | 3,742.72 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 1,804.32 |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 93,835,991.05 |
| | 本期末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负 债 和 所 有 者 权 益 | |
| 负 债： | |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | - |
| 应付证券清算款 | 3,276,669.31 |
| 应付赎回款 | 5,381.17 |
| 应付管理人报酬 | 97,950.85 |
| 应付托管费 | 16,325.12 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 305,133.54 |
| 应交税费 | - |

| | |
|---------------|---------------|
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 145,005.80 |
| 负债合计 | 3,846,465.79 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 72,320,067.59 |
| 未分配利润 | 17,669,457.67 |
| 所有者权益合计 | 89,989,525.26 |
| 负债和所有者权益总计 | 93,835,991.05 |

注：(1) 报告截止日 2016 年 12 月 31 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人民币 1.244 元，基金份额总额 72,320,067.59 份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|
| 一、收入 | -784,544.33 |
| 1. 利息收入 | 126,351.88 |
| 其中：存款利息收入 | 58,358.02 |
| 债券利息收入 | 34,403.06 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 33,590.80 |
| 其他利息收入 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 1,786,118.61 |
| 其中：股票投资收益 | 1,730,629.10 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 13,788.00 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 41,701.51 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -2,852,904.56 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - |

| | |
|----------------------------|----------------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 155,889.74 |
| 减：二、费用 | 1,203,585.87 |
| 1. 管理人报酬 | 339,245.66 |
| 2. 托管费 | 56,540.91 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 548,374.32 |
| 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 | 259,334.16 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -1,988,130.20 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -1,988,130.20 |

注：本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、基金合同生效日所有者权益（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） | - | -1,988,130.20 | -1,988,130.20 |
| 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） | 61,312,803.28 | 16,701,381.61 | 78,014,184.89 |
| 其中：1. 基金申购款 | 96,126,960.11 | 26,090,580.15 | 122,217,540.26 |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列） | -34,814,156.83 | -9,389,198.54 | -44,203,355.37 |
| 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） | 72,320,067.59 | 17,669,457.67 | 89,989,525.26 |

注：本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月

31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|--------------|--------------|-------------|
| _____ 王立新 | _____ 凌宇翔 | _____ 龚飒 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原“银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金”），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，由银华基金管理股份有限公司于 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”。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，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、创业板股票及其他经中国证券监督管理委员会（以下简称“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他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，其投资比例遵循届时有

效的法律法规和相关规定。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%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准：中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重

要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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收益/（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，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 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票面利率计算的金额，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），在回购期内逐日计提；

(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，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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。

7.4.4.10 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) 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额；
- (3) 本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- (4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：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按红利再投日的基金份额净值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。红利再投资方式免收再投资的费用；
- (6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (7) 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；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充

通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 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 号文《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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 东北证券股份有限公司（“东北证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 山西海鑫实业股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 银华基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 银华财富资本管理（北京）有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 银华国际资本管理有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 深圳银华永泰创新投资有限公司 | 基金管理人子公司的子公司 |

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2016年8月9日，银华基金管理有限公司变更名称为银华基金管理股份有限公司。

7.4.8 本报告期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年4月25日至2016年12月31日 | |
|-------|------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 东北证券 | 1,608,271.50 | 0.41% |
| 西南证券 | 46,340,336.63 | 11.79% |
| 第一创业 | 31,986,058.63 | 8.14% |

注：本报告期系2016年4月25日（基金合同生效日）至2016年12月31日止。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于2016年4月25日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于2016年4月25日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于2016年4月25日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未通过关联方

交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年4月25日至2016年12月31日 | | | |
|-------|------------------------------|------------|-----------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 东北证券 | 1,497.79 | 0.42% | - | - |
| 西南证券 | 43,156.99 | 12.04% | 43,156.99 | 14.14% |
| 第一创业 | 29,788.58 | 8.31% | 29,788.58 | 9.76% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

本报告期系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年4月25日至2016年12月31日 |
|-----------------|------------------------------|
| | 当期应支付的管理费 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 61,173.68 |

注：1、基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

2、本报告期系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年4月25日至2016年12月31日 |
|----|------------------------------|
| | 当期应支付的托管费 |

注：1、基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

2、本报告期系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | |
|--------|-----------------------------------|-----------|
| | 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 7,998,209.66 | 53,113.62 |

注：本报告期系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------|------|--------|------|--------|---------|--------|--------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

| | | | | | | | 股) | | | |
|--------|------|---------------------|------------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 603877 | 太平鸟 | 2016年 12月 29日 | 2017 年 1月 9日 | 新股流 通受限 | 21.30 | 21.30 | 1,050 | 22,365.00 | 22,365.00 | - |
| 002838 | 道恩股份 | 2016年 12月 28日 | 2017 年 1月 6日 | 新股流 通受限 | 15.28 | 15.28 | 682 | 10,420.96 | 10,420.96 | - |
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016年 12月 27日 | 2017 年 1月 5日 | 新股流 通受限 | 10.44 | 10.44 | 739 | 7,715.16 | 7,715.16 | - |
| 300591 | 万里马 | 2016年 12月 30日 | 2017 年 1月 10日 | 新股流 通受限 | 3.07 | 3.07 | 1,838 | 5,642.66 | 5,642.66 | - |

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.9.2 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 |
|--------|------|-------------------------|----------|----------------|--------------------|----------------|---------|------------|------------|----|
| 000540 | 中天城投 | 2016 年 11月 28日 | 重大事 项 | 6.93 | 2017 年1月 3日 | 7.00 | 104,100 | 691,880.47 | 721,413.00 | - |
| 002400 | 省广股份 | 2016 年 11月 28日 | 重大事 项 | 13.79 | - | - | 51,600 | 703,790.00 | 711,564.00 | - |
| 600537 | 亿晶光电 | 2016 年 12月 27日 | 重大事 项 | 7.43 | 2017 年1月 13日 | 8.17 | 95,600 | 740,365.46 | 710,308.00 | - |
| 002681 | 奋达科技 | 2016 年 12月 19日 | 重大事 项 | 12.93 | - | - | 53,200 | 746,397.42 | 687,876.00 | - |
| 600303 | 曙光股 | 2016 | 重大事 | 9.02 | 2017 | 9.92 | 72,000 | 747,423.81 | 649,440.00 | - |

| | 份 | 年 | 项 | | 年 1 月 | | | | | |
|--------|-------|-----------------|------|-------|-----------------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | | 12 月 | | | 17 日 | | | | | |
| | | 15 日 | | | | | | | | |
| 000050 | 深天马 A | 2016 年 9 月 12 日 | 重大事项 | 18.82 | - | - | 800 | 15,384.00 | 15,056.00 | - |
| 300276 | 三丰智能 | 2016 年 9 月 12 日 | 重大事项 | 18.15 | - | - | 800 | 14,904.00 | 14,520.00 | - |
| 002396 | 星网锐捷 | 2016 年 9 月 12 日 | 重大事项 | 19.70 | 2017 年 2 月 21 日 | 18.35 | 700 | 13,566.00 | 13,790.00 | - |
| 000547 | 航天发展 | 2016 年 4 月 19 日 | 重大事项 | 15.36 | 2017 年 1 月 3 日 | 16.90 | 509 | 18,522.51 | 7,818.24 | - |
| 000693 | ST 华泽 | 2016 年 3 月 1 日 | 重大事项 | 12.50 | - | - | 332 | 8,363.53 | 4,150.00 | - |

7.4.9.3 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 81,258,000.00 元，属于第二层次的余额为人民币 3,582,079.02 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 23,001.52 元，无第二层次转入第一层次的金额。

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

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告(转型前)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 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 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 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 |

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 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 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.yhfund.com.cn>) 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|
| 1 | 000982 | 中银绒业 | 39,157.74 | 0.25 |
| 2 | 002091 | 江苏国泰 | 7,827.18 | 0.05 |

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|-----------|
| 买入股票成本（成交）总额 | - |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 46,984.92 |

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 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 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金 2016 年 4 月 24 日未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 |

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§8 投资组合报告(转型后)**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 84,840,079.02 | 90.41 |
| | 其中：股票 | 84,840,079.02 | 90.41 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,921,927.09 | 9.51 |
| 7 | 其他资产 | 73,984.94 | 0.08 |
| 8 | 合计 | 93,835,991.05 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|---------|
|----|------|------|---------|

| | | | 比例 (%) |
|---|------------------|---------------|--------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,721,640.00 | 1.91 |
| B | 采矿业 | 6,284,112.00 | 6.98 |
| C | 制造业 | 33,360,249.06 | 37.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,667,219.00 | 2.96 |
| E | 建筑业 | 4,926,895.23 | 5.47 |
| F | 批发和零售业 | 11,937,620.54 | 13.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,718,096.00 | 4.13 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,139,204.24 | 5.71 |
| J | 金融业 | 4,472,941.30 | 4.97 |
| K | 房地产业 | 5,592,683.00 | 6.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,133,143.65 | 1.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,056,121.00 | 3.40 |
| S | 综合 | 830,154.00 | 0.92 |
| | 合计 | 84,840,079.02 | 94.28 |

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细(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 | 600350 | 山东高速 | 219,700 | 1,423,656.00 | 1.58 |
| 2 | 600297 | 广汇汽车 | 162,800 | 1,393,568.00 | 1.55 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 600015 | 华夏银行 | 127,700 | 1,385,545.00 | 1.54 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 81,600 | 1,383,936.00 | 1.54 |
| 5 | 601929 | 吉视传媒 | 330,200 | 1,383,538.00 | 1.54 |
| 6 | 600089 | 特变电工 | 151,300 | 1,381,369.00 | 1.54 |
| 7 | 600335 | 国机汽车 | 113,600 | 1,380,240.00 | 1.53 |
| 8 | 600278 | 东方创业 | 84,500 | 1,379,040.00 | 1.53 |
| 9 | 600216 | 浙江医药 | 108,600 | 1,377,048.00 | 1.53 |
| 10 | 601390 | 中国中铁 | 155,300 | 1,375,958.00 | 1.53 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

(<http://www.yhfund.com.cn>) 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 601818 | 光大银行 | 2,247,761.00 | 2.50 |
| 2 | 600089 | 特变电工 | 2,153,708.20 | 2.39 |
| 3 | 600129 | 太极集团 | 2,149,849.00 | 2.39 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 2,128,010.00 | 2.36 |
| 5 | 600741 | 华域汽车 | 2,048,010.04 | 2.28 |
| 6 | 600068 | 葛洲坝 | 1,952,345.00 | 2.17 |
| 7 | 300383 | 光环新网 | 1,682,930.00 | 1.87 |
| 8 | 600100 | 同方股份 | 1,673,565.00 | 1.86 |
| 9 | 600690 | 青岛海尔 | 1,635,465.00 | 1.82 |
| 10 | 601992 | 金隅股份 | 1,587,505.00 | 1.76 |
| 11 | 600685 | 中船防务 | 1,564,651.92 | 1.74 |
| 12 | 600583 | 海油工程 | 1,538,408.00 | 1.71 |
| 13 | 600270 | 外运发展 | 1,517,629.88 | 1.69 |
| 14 | 600278 | 东方创业 | 1,513,357.00 | 1.68 |
| 15 | 601225 | 陕西煤业 | 1,498,507.00 | 1.67 |
| 16 | 601390 | 中国中铁 | 1,483,092.00 | 1.65 |
| 17 | 601898 | 中煤能源 | 1,462,693.00 | 1.63 |
| 18 | 600188 | 兖州煤业 | 1,459,975.00 | 1.62 |
| 19 | 600076 | 康欣新材 | 1,454,953.00 | 1.62 |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 1,452,832.16 | 1.61 |

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 601818 | 光大银行 | 2,260,718.00 | 2.51 |
| 2 | 600685 | 中船防务 | 1,595,498.58 | 1.77 |
| 3 | 000555 | 神州信息 | 1,354,305.00 | 1.50 |
| 4 | 600073 | 上海梅林 | 1,296,460.20 | 1.44 |
| 5 | 600312 | 平高电气 | 1,295,762.26 | 1.44 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 1,078,649.04 | 1.20 |
| 7 | 000876 | 新希望 | 1,020,253.00 | 1.13 |
| 8 | 002769 | 普路通 | 942,497.00 | 1.05 |
| 9 | 000021 | 深科技 | 929,417.36 | 1.03 |
| 10 | 600745 | 中茵股份 | 907,726.00 | 1.01 |
| 11 | 600129 | 太极集团 | 878,810.00 | 0.98 |
| 12 | 600582 | 天地科技 | 874,992.00 | 0.97 |
| 13 | 600150 | 中国船舶 | 870,110.00 | 0.97 |
| 14 | 002233 | 塔牌集团 | 840,310.10 | 0.93 |
| 15 | 002130 | 沃尔核材 | 837,279.50 | 0.93 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 836,405.00 | 0.93 |
| 17 | 300146 | 汤臣倍健 | 833,804.00 | 0.93 |
| 18 | 600741 | 华域汽车 | 827,609.00 | 0.92 |
| 19 | 601633 | 长城汽车 | 823,541.68 | 0.92 |
| 20 | 600039 | 四川路桥 | 820,734.19 | 0.91 |

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 237,906,517.65 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 155,187,414.12 |

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 32,608.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | 35,829.37 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,742.72 |
| 5 | 应收申购款 | 1,804.32 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 73,984.94 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息(转型前)**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|-------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,388 | 7,930.31 | - | - | 11,007,264.31 | 100.00% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§9 基金份额持有人信息(转型后)**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|-------|------------|-------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-------|-----------|---------------|--------|--------------|--------|
| 1,290 | 56,062.07 | 62,892,598.39 | 86.96% | 9,427,469.20 | 13.04% |
|-------|-----------|---------------|--------|--------------|--------|

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,171.71 | 0.00% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

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 | 96,126,960.11 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 34,814,156.83 |
| 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 | 72,320,067.59 |

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 |

§11 重大事件揭示

11.1 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”。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2016 年 9 月 3 日发布公告，经银华基金管理有限公司 2016 年第 1 次临时股东大会审议通过，选举李福春先生、常忠先生担任银华基金管理有限公司第六届董事会董事。经银华基金管理有限公司董事会、股东会审议通过，深圳市市场监督管理局核准，银华基金管理有限公司变更为“银华基金管理股份有限公司”。经银华基金管理股份有限公司创立大会暨 2016 年第一次股东大会审议通过，选举王珠林先生、钱龙海先生、李福春先生、吴坚先生、郑秉文先生、刘星先生、邢冬梅女士、封和平先生、王立新先生为本公司第一届董事会董事。其中，吴坚先生为新任董事，邢冬梅女士、封和平先生为新任独立董事。常忠先生不再继续担任本公司董事。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。目前，该审计机构已为本基金提供连续提供了 4 年的服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|------------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券股份有限公司 | 3 | 93,100,285.82 | 23.69% | 86,704.13 | 24.20% | 新增 1 个交易单元 |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | 65,054,719.56 | 16.55% | 60,586.60 | 16.91% | - |
| 西南证券股份有限公司 | 1 | 46,340,336.63 | 11.79% | 43,156.99 | 12.04% | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 5 | 41,438,583.70 | 10.54% | 32,974.29 | 9.20% | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | 2 | 31,986,058.63 | 8.14% | 29,788.58 | 8.31% | - |
| 上海华信证券有限责任公司 | 1 | 28,668,330.83 | 7.29% | 26,698.15 | 7.45% | - |
| 民生证券有限责任公司 | 2 | 24,694,101.07 | 6.28% | 22,997.75 | 6.42% | - |
| 广发证券股份有限公司 | 2 | 10,525,579.76 | 2.68% | 9,802.45 | 2.74% | - |
| 东吴证券股份有限公司 | 3 | 10,419,407.84 | 2.65% | 7,619.56 | 2.13% | - |
| 方正证券股份有限公司 | 5 | 9,881,383.90 | 2.51% | 9,202.68 | 2.57% | - |
| 国金证券股份有限公司 | 2 | 6,300,825.14 | 1.60% | 5,867.99 | 1.64% | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 2 | 4,931,384.96 | 1.25% | 4,592.65 | 1.28% | - |

| | | | | | | |
|------------------------|---|--------------|-------|----------|-------|----------------|
| 长城证券有限 责任公司 | 3 | 4,312,147.03 | 1.10% | 4,015.91 | 1.12% | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | 1 | 3,345,473.46 | 0.85% | 3,115.76 | 0.87% | - |
| 长江证券股份 有限公司 | 2 | 2,888,980.70 | 0.74% | 2,690.57 | 0.75% | - |
| 申万宏源集团 股份有限公司 | 2 | 2,496,553.74 | 0.64% | 2,325.11 | 0.65% | - |
| 中国中投证券 有限责任公司 | 1 | 2,183,882.96 | 0.56% | 2,033.84 | 0.57% | - |
| 东北证券股份 有限公司 | 4 | 1,608,271.50 | 0.41% | 1,497.79 | 0.42% | 新增 1 个交 易单元 |
| 中信证券股份 有限公司 | 3 | 1,341,897.71 | 0.34% | 1,249.71 | 0.35% | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | 1 | 654,101.00 | 0.17% | 609.22 | 0.17% | - |
| 上海证券有限 责任公司 | 1 | 500,745.00 | 0.13% | 466.37 | 0.13% | - |
| 华创证券有限 责任公司 | 2 | 248,765.55 | 0.06% | 231.69 | 0.06% | - |
| 国泰君安证券 股份有限公司 | 2 | 90,799.00 | 0.02% | 84.57 | 0.02% | - |
| 湘财证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中原证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国民族证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山 东）有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------------|---|---|---|---|---|----------------|
| 首创证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国融证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券有限 责任公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交 易单元 |
| 渤海证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券股份 | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个交 |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|-----|
| 有限公司 | | | | | | 易单元 |
| 东兴证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 |
| 东方证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份 有限公司 | 599,880.00 | 5.09% | - | - | - | - |
| 西南证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份 有限公司 | - | - | 39,000,000.00 | 41.53% | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券有限 责任公司 | 384,788.50 | 3.26% | - | - | - | - |
| 广发证券股份 有限公司 | 3,360,478.60 | 28.50% | 1,600,000.00 | 1.70% | - | - |
| 东吴证券股份 有限公司 | 1,519,500.00 | 12.89% | - | - | - | - |
| 方正证券股份 有限公司 | 3,893,002.00 | 33.01% | 20,000,000.00 | 21.30% | - | - |
| 国金证券股份 有限公司 | 903,038.40 | 7.66% | 14,600,000.00 | 15.55% | - | - |
| 中银国际证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|------------|-------|---------------|--------|---|---|
| 责任公司 | | | | | | |
| 中国银河证券股份有限公司 | 604,761.00 | 5.13% | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团股份有限公司 | 425,361.00 | 3.61% | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | - | - | 18,700,000.00 | 19.91% | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限责任公司 | 101,500.50 | 0.86% | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国民族证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国融证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|-----------|--------------|-----------|------------|------------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 华泰证券股份有限公司 | 5 | 39,157.74 | 83.34% | 36.47 | 83.34% | |
| 国金证券股份有限公司 | 2 | 7,827.18 | 16.66% | 7.29 | 16.66% | - |
| 华安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券有限责任公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易单元 |
| 东北证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 新增 1 个交易单元 |
| 东方证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增 1 个交易单元 |
| 东吴证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 有限公司 | | | | | | |
| 广发证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国融证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 中国国际金融 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份 有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中原证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团 股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国民族证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山 东）有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份 有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份 有限公司 | - | - | 3,600,000.00 | 6.47% | - | - |
| 渤海证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份 有限公司 | - | - | 20,500,000.00 | 36.87% | - | - |
| 东吴证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份 有限公司 | - | - | 500,000.00 | 0.90% | - | - |
| 光大证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份 | - | - | 9,300,000.00 | 16.73% | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---------------|--------|---|---|
| 有限公司 | | | | | | |
| 广州证券有限 责任公司 | - | - | 17,200,000.00 | 30.94% | - | - |
| 国都证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国融证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份 有限公司 | - | - | 3,000,000.00 | 5.40% | - | - |
| 中国国际金融 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-----------------------|---|---|--------------|-------|---|---|
| 有限公司 | | | | | | |
| 中原证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团 股份有限公司 | - | - | 1,500,000.00 | 2.70% | - | - |
| 中国民族证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山 东）有限任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券 有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

注：本基金本报告期未通过交易单元进行债券交易及权证交易。

银华基金管理股份有限公司
2017年3月31日