

# 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

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 重要提示及目录

### 1.1 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）。



## 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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	22
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.....	22
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表(转型前)</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表(转型前).....	24
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
<b>§7 年度财务报表(转型后)</b> .....	<b>51</b>

7.1 资产负债表（转型后） .....	51
7.2 利润表 .....	53
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	54
7.4 报表附注 .....	54
<b>§8 投资组合报告(转型前) .....</b>	<b>77</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	77
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	77
8.3 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 .....	78
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	90
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 .....	91
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 .....	91
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 .....	91
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 .....	91
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	91
8.12 投资组合报告附注 .....	92
<b>§8 投资组合报告(转型后) .....</b>	<b>92</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	92
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	93
8.3 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) .....	94
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	99
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 .....	99
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 .....	99
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 .....	99
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 .....	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	99
8.12 投资组合报告附注 .....	99
<b>§9 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>	<b>100</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	100
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	100
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 .....	100
<b>§9 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>	<b>100</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	100
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	101
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 .....	101
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>101</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>102</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	102
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 .....	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	102
11.4 基金投资策略的改变 .....	102
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	103

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.....	103
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	103
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	109
11.8 其他重大事件（转型后）.....	114
11.8 其他重大事件（转型前）.....	119
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>124</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>124</b>
13.1 备查文件目录.....	124
13.2 存放地点.....	124
13.3 查阅方式.....	124

## §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×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
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住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	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 12 月 31 日）		2015 年	2014 年
	转型前 （2016 年 1 月 1 日-2016 年	转型后 （2016 年 4 月 25 日-2016 年		

	4月24日)	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%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	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

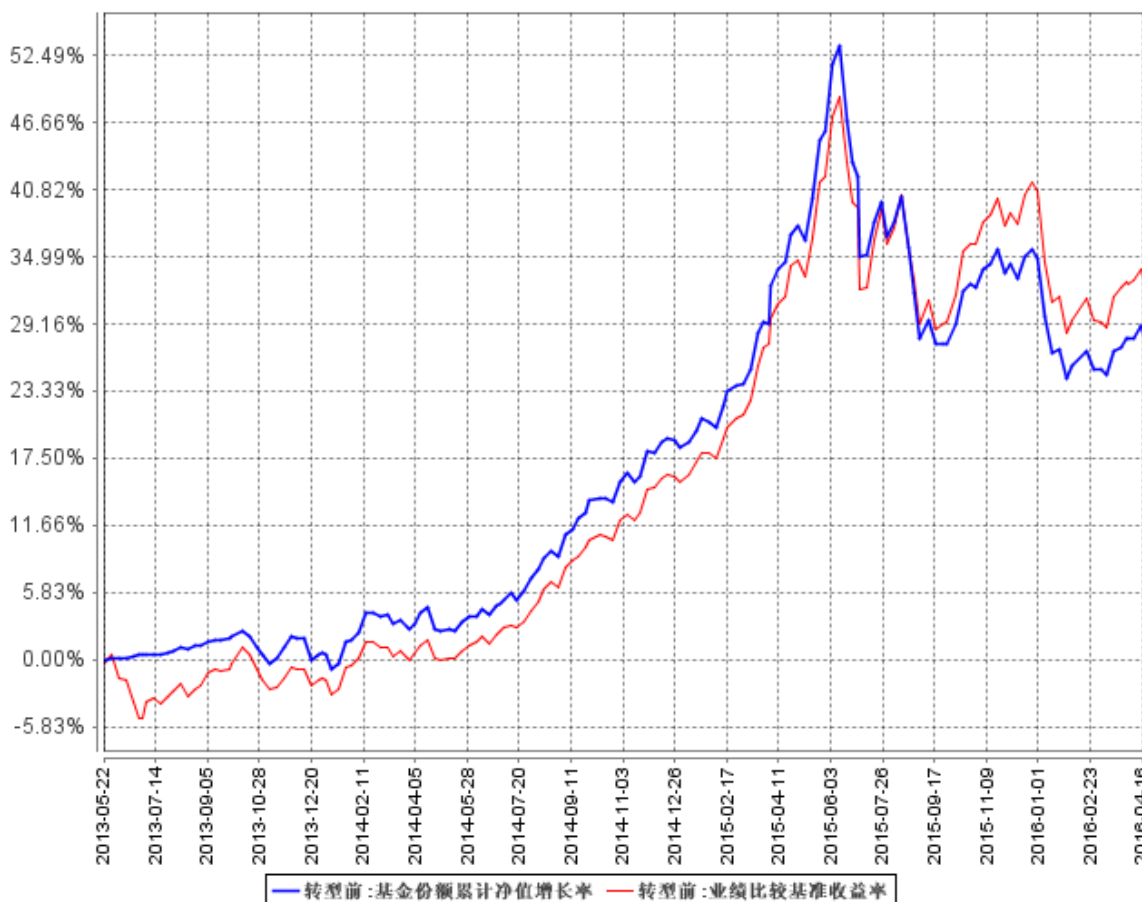
阶段	转型前				①-③	②-④
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④		
2016年						

1月1日至 2016年 4月24日						
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 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 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

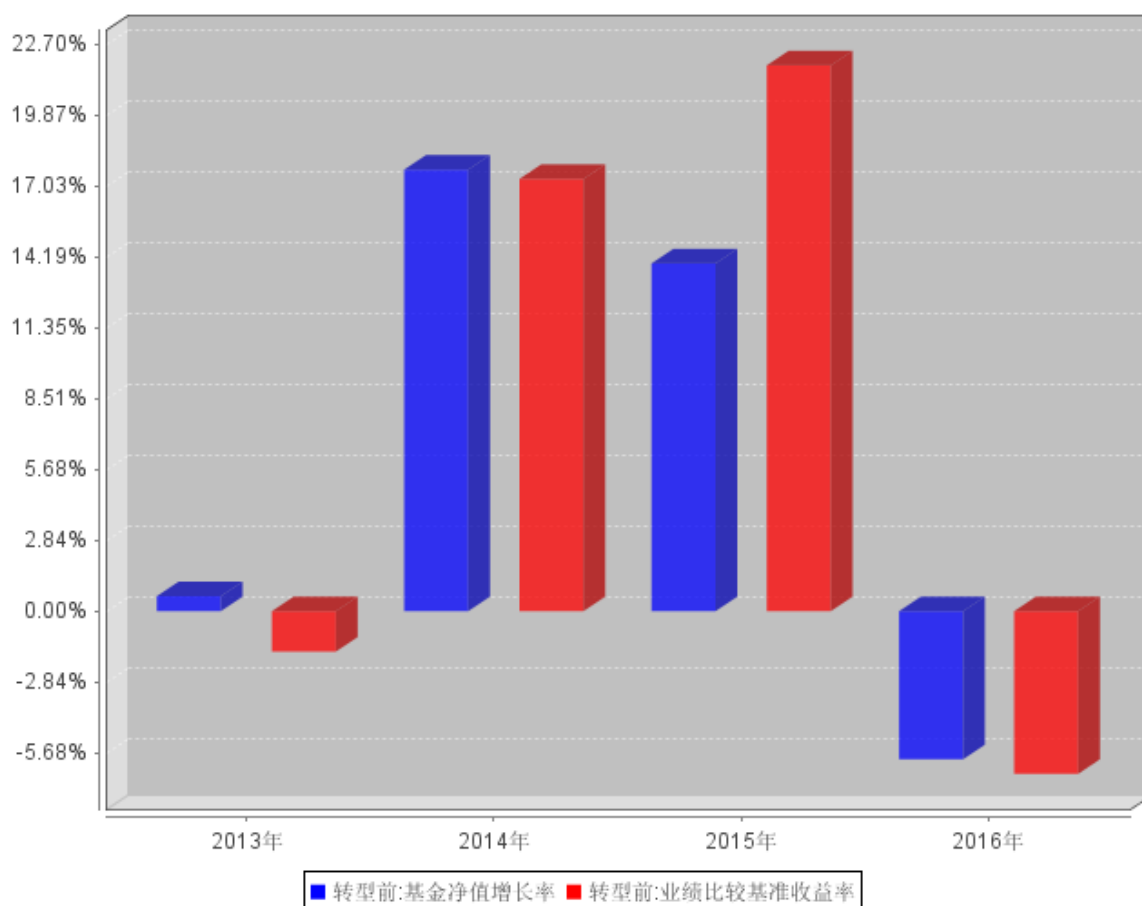
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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%

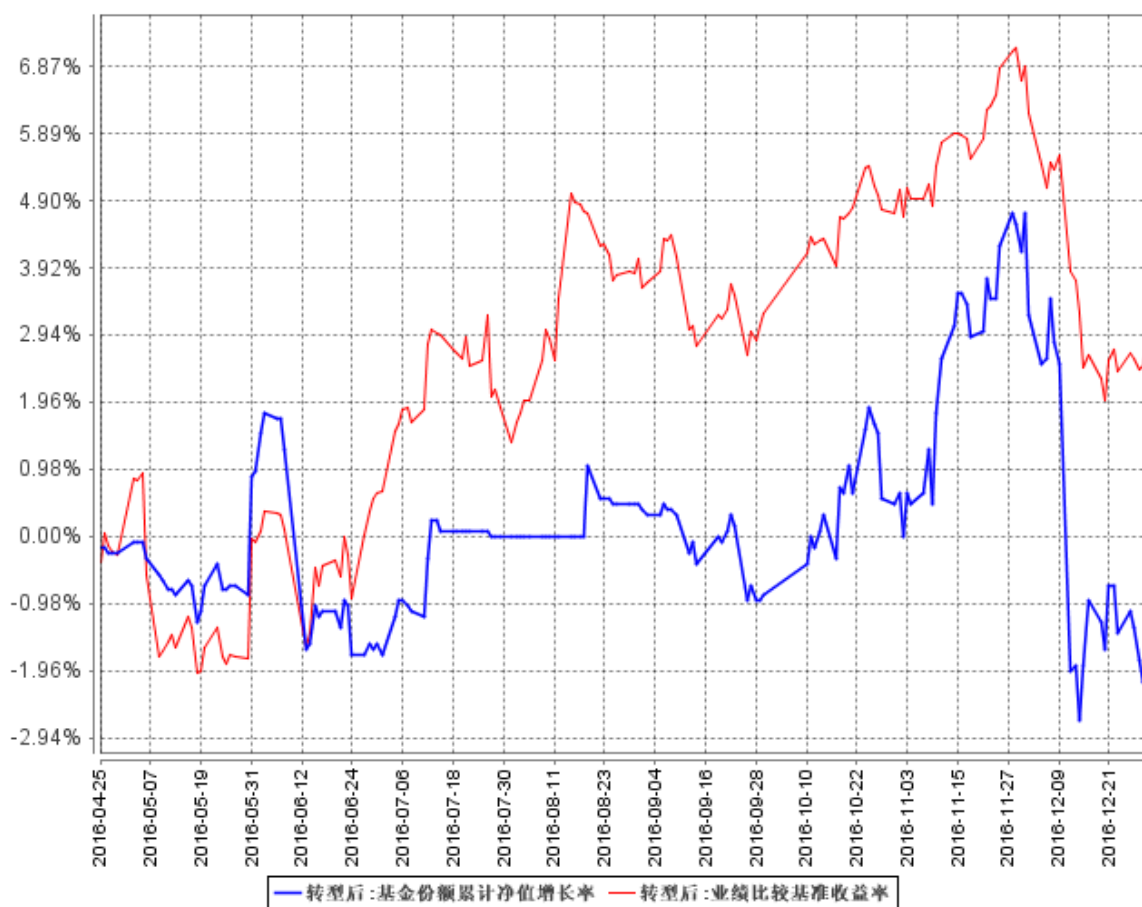
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券市场中选取 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内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。

### 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

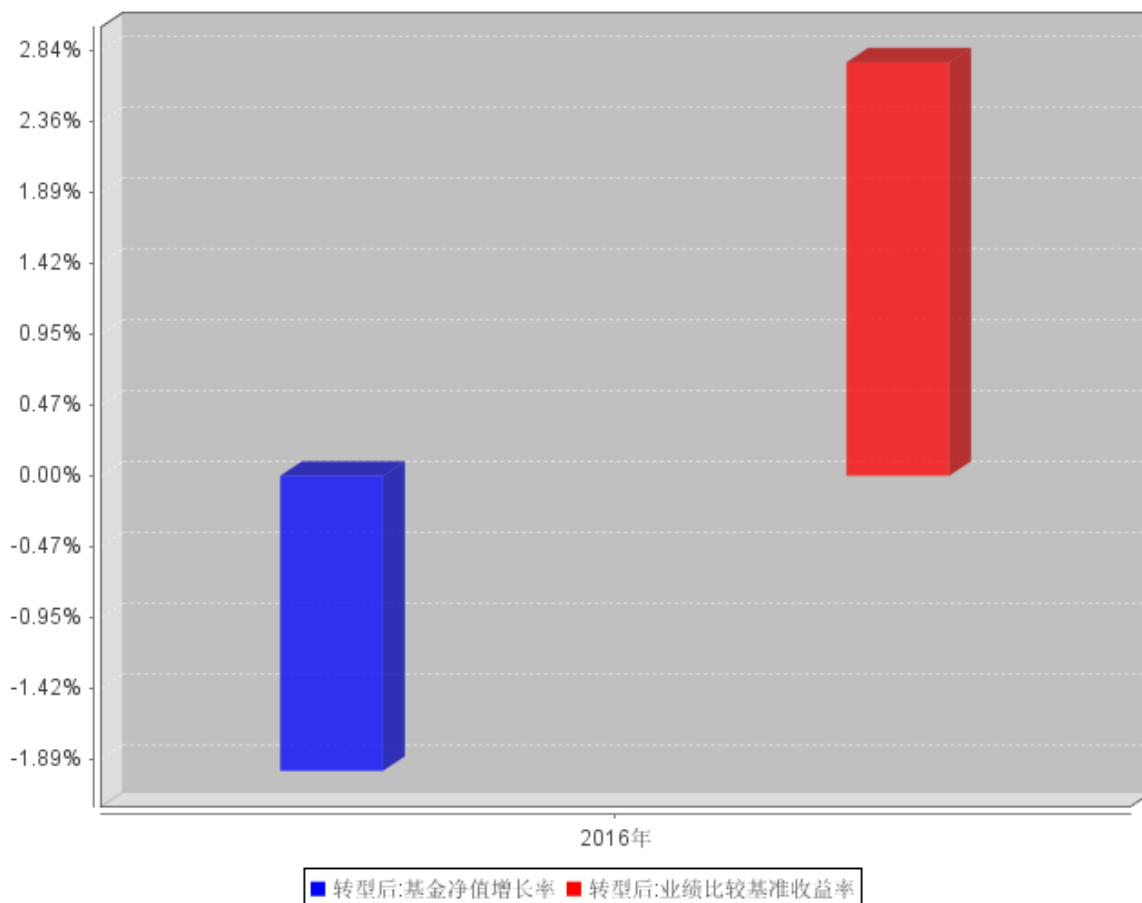
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同基金的特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。首先，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果，部门总监签字确认后，将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节，持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工

作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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）

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60468687_A48 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金全体基金份额持有人；
引言段	我们审计了后附的银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金财务报表，包括 2016 年 4 月 24 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银华基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道



	<p>德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金 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。
注册会计师的姓名	徐 艳 马剑英
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日

## §6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60468687_A29 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银华基金管理股份有限

	公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 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。
注册会计师的姓名	徐 艳 马剑英
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日

## §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	附注号	本期末 2016 年 4 月 24 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,928.48	200,000.00
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
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>本期末 2016年4月24日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	-	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	11,007,264.31	11,717,799.09
未分配利润	7.4.7.10	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	附注号	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
<b>一、收入</b>		-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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	17,660.65	5,246,883.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	524,300.30
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,408.12	33,904.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	20,571.43	114,547.51
<b>减：二、费用</b>		236,246.96	1,007,758.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	28,349.62	142,977.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,449.92	47,658.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	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	-11,899,194.65	-4,490,794.70	-16,389,989.35

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
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 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 1 月 1 日至 2016 年 4 月 24 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

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易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 0.60% 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 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.015% 的年费率逐日计提；

(4) 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）在回购期内逐日计提；

(5) 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。如果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。

#### **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三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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月24日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	517,223.94	682,877.99
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	517,223.94	682,877.99

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月24日		
	成本	公允价值	估值增值
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
项目	上年度末		

		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		3,208,387.25	4,100,705.44	892,318.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	11,778,522.00	11,832,450.00	53,928.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,778,522.00	11,832,450.00	53,928.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,986,909.25	15,933,155.44	946,246.19

#### 7.4.7.3 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 24 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,367.84	182.30
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	40.59
应收债券利息	145,673.43	295,477.81
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	29.54	29.26
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.20	1.54
合计	147,227.36	295,731.50

#### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 24 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	353.09
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	-	353.09

**7.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年4月24日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.41	2,524.29
预提费用	153,400.15	345,000.00
指数使用费	63,186.81	50,000.00
合计	216,597.37	397,524.29

**7.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年4月24日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	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

注：本期申购中包含转换入份额及金额，本期赎回中包含转换出份额及金额。

**7.4.7.9 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	-70,771.86	-892,883.22	-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	5,003,214.64	-2,047,008.38	2,956,206.26

**7.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 4月24日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日



活期存款利息收入	2,238.66	22,771.02
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	3,033.99
其他	2.22	294.85
合计	2,536.16	26,099.86

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 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	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	46,984.92	14,587,555.81
减：卖出股票成本总额	29,324.27	9,340,672.78
买卖股票差价收入	17,660.65	5,246,883.03

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	524,300.30
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	-	524,300.30

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	42,046,146.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	40,060,129.70
减：应收利息总额	-	1,461,716.55

买卖债券差价收入	-	524,300.30
----------	---	------------

#### 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资差价收入。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖衍生工具差价收入。

#### 7.4.7.15 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,408.12	33,904.17
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,408.12	33,904.17

#### 7.4.7.16 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-892,883.22	-1,681,263.37
——股票投资	-866,783.22	-1,108,039.07
——债券投资	-26,100.00	-573,224.30
——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	-1,681,263.37

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 4月24日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
基金赎回费收入	19,869.89	97,470.96
转换费	701.54	17,076.55

合计	20,571.43	114,547.51
----	-----------	------------

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	94.92	35,548.69
银行间市场交易费用	-	700.00
合计	94.92	36,248.69

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	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
审计费用	14,139.25	45,000.00
信息披露费	94,260.90	300,000.00
银行费用	310.00	3,817.71
指数使用费	63,186.81	200,000.00
账户维护费	18,800.00	36,450.00
其他	-	560.00
合计	190,696.96	585,827.71

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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 <sup>1</sup>	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

##### 7.4.10.2.2 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

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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

#### 7.4.10.6 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内参与关联方承销证券

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2016 年 4 月 24 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

## 7.4.12.2 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	14.60	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	2016 年	重大事项	15.40	2017 年	16.90	509	18,522.51	7,838.60	-

	发展	4月19日	项		1月3日					
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	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	-



### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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金资产净值的 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很小；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。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。于本报告期末及上年度报告期末，本基金所持有的交易性金融资产中债券投资占一定比率，因此市场利率波动会对基金净值产生一定影响。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 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
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 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
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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%。

于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 4 月 24 日		上年度末 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

#### 7.4.13.4.2.2 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（或报告期）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 24 日）	上年度末（2015 年 12 月 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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）。

## 7.4.14.2 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。

## 7.4.14.3 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。

## 7.4.14.4 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	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		35,829.37
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-
资产总计		93,835,991.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 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	7.4.7.3	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	145,005.80
负债合计		3,846,465.79
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	72,320,067.59
未分配利润	7.4.7.10	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	附注号	本期
		2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-784,544.33
1. 利息收入		126,351.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	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	7.4.7.12	1,730,629.10

基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	13,788.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	41,701.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	155,889.74
<b>减：二、费用</b>		<b>1,203,585.87</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	339,245.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	56,540.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	259,334.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,988,130.20</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,988,130.20</b>

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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	7,998,209.66
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,998,209.66

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。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	87,639,620.61	84,840,079.02	-2,799,541.59
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	87,639,620.61	84,840,079.02	-2,799,541.59

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。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,069.34
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	457.27
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,199.94
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	16.17
合计	3,742.72

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。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。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。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	305,133.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	305,133.54

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。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.80

预提费用	145,000.00
合计	145,005.80

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。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 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	96,126,960.11	96,126,960.11
本期赎回（以“-”号填列）	-34,814,156.83	-34,814,156.83
本期末	72,320,067.59	72,320,067.59

注：本期申购含红利再投、转换转入份额及金额，赎回含转换转出份额及金额。

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。

#### 7.4.7.10 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	5,003,214.64	-2,047,008.38	2,956,206.26
本期利润	864,774.36	-2,852,904.56	-1,988,130.20
本期基金份额交易产生的变动数	29,515,853.59	-12,814,471.98	16,701,381.61
其中：基金申购款	45,582,059.75	-19,491,479.60	26,090,580.15
基金赎回款	-16,066,206.16	6,677,007.62	-9,389,198.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,383,842.59	-17,714,384.92	17,669,457.67

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。

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入
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	2,720.44
其他	2,523.96
合计	58,358.02

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。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	155,187,414.12
卖出股票成本总额	153,456,785.02
买卖股票差价收入	1,730,629.10

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。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月25日至2016年12月31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	13,788.00
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	13,788.00

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。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月25日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,972,386.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,778,522.00
减：应收利息总额	180,076.49
买卖债券差价收入	13,788.00

##### 7.4.7.13.3 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 12 月 31 日止会计期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 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 12 月 31 日止会计期间无贵金属

投资收益。

#### 7.4.7.15 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 12 月 31 日止期间无买卖衍生工具差价收入。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	41,701.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	41,701.51

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。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,852,904.56
——股票投资	-2,825,076.56
——债券投资	-27,828.00
——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	-2,852,904.56

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。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	154,590.95
转换费	1,298.69
其他	0.10
合计	155,889.74

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。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	548,374.32
银行间市场交易费用	-
合计	548,374.32

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。

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	30,860.75
信息披露费	205,739.10
银行费用	3,774.31
指数使用费	-
账户维护费	18,300.00
其他	660.00
合计	259,334.16

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 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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。

## 7.4.10 本报告期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 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	339,245.66
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% 的年费率计提。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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	56,540.91

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% 的年费率计提。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。

### 7.4.10.3 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 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 日止期间未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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本报告期末未持有本基金份额。

#### 7.4.10.5 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 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。

#### 7.4.10.6 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内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2016 年	2017	新股流	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-

	股份	12月28日	年1月6日	通受限						
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。

#### 7.4.12.2 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
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	曙光股份	2016年12月15日	重大事项	9.02	2017年1月17日	9.92	72,000	747,423.81	649,440.00	-
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	-

#### 7.4.12.3 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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金资产净值的 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很小；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。

### 7.4.13.3 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 7.4.12 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，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金持有的交易性金融资产中债券投资比重较低，因此基金净值受利率变动的影响较小。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2016 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	7,998,209.66	-	-	-	-	-	7,998,209.66
结算备付金	923,717.43	-	-	-	-	-	923,717.43
存出保证金	32,608.53	-	-	-	-	-	32,608.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-84,840,079.02	84,840,079.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	35,829.37	35,829.37

应收利息	-	-	-	-	3,742.72	3,742.72
应收申购款	-	-	-	-	1,804.32	1,804.32
资产总计	8,954,535.62	-	-	-	84,881,455.43	93,835,991.05
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	3,276,669.31	3,276,669.31
应付赎回款	-	-	-	-	5,381.17	5,381.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	97,950.85	97,950.85
应付托管费	-	-	-	-	16,325.12	16,325.12
应付交易费用	-	-	-	-	305,133.54	305,133.54
其他负债	-	-	-	-	145,005.80	145,005.80
负债总计	-	-	-	-	3,846,465.79	3,846,465.79
利率敏感度缺口	8,954,535.62	-	-	-	-81,034,989.64	89,989,525.26

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此以外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

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%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	84,840,079.02	94.28
交易性金融资产-基金投资	-	-

交易性金融资产-债券投资	-	-
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	84,840,079.02	94.28

#### 7.4.13.4.2.2 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 系数是根据基金成立至本报告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，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 12 月 31 日）
	+5%	3,792,965.84
	-5%	-3,792,965.84

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 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。

## 7.4.14.3 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。

## 7.4.14.4 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

## 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	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
11	600811	东方集团	191,700	1,370,655.00	1.52
12	600642	申能股份	233,500	1,370,645.00	1.52
13	601898	中煤能源	235,900	1,370,579.00	1.52
14	600757	长江传媒	164,700	1,368,657.00	1.52
15	600076	康欣新材	145,700	1,368,123.00	1.52
16	600170	上海建工	288,600	1,365,078.00	1.52
17	600755	厦门国贸	166,300	1,363,660.00	1.52
18	600583	海油工程	184,700	1,363,086.00	1.51
19	601225	陕西煤业	280,800	1,361,880.00	1.51
20	600623	华谊集团	101,100	1,358,784.00	1.51
21	600270	外运发展	82,000	1,356,280.00	1.51
22	600068	葛洲坝	143,000	1,314,170.00	1.46
23	600188	兖州煤业	120,600	1,309,716.00	1.46
24	600177	雅戈尔	91,900	1,284,762.00	1.43
25	600155	宝硕股份	85,790	1,284,276.30	1.43
26	300383	光环新网	50,800	1,267,968.00	1.41
27	600729	重庆百货	53,978	1,264,704.54	1.41
28	600741	华域汽车	79,200	1,263,240.00	1.40
29	600129	太极集团	73,500	1,260,525.00	1.40
30	600694	大商股份	31,500	1,257,795.00	1.40
31	601098	中南传媒	75,400	1,256,164.00	1.40

32	600366	宁波韵升	63,600	1,252,284.00	1.39
33	600835	上海机电	64,100	1,251,232.00	1.39
34	601966	玲珑轮胎	46,200	1,242,318.00	1.38
35	600826	兰生股份	45,200	1,234,864.00	1.37
36	600845	宝信软件	69,500	1,225,980.00	1.36
37	601992	金隅股份	215,100	959,346.00	1.07
38	600240	华业资本	88,000	945,120.00	1.05
39	600690	青岛海尔	95,600	944,528.00	1.05
40	600418	江淮汽车	81,400	940,984.00	1.05
41	600100	同方股份	67,800	939,030.00	1.04
42	600999	招商证券	57,500	938,975.00	1.04
43	601111	中国国航	130,300	938,160.00	1.04
44	600657	信达地产	153,400	935,740.00	1.04
45	600783	鲁信创投	36,700	830,154.00	0.92
46	000540	中天城投	104,100	721,413.00	0.80
47	002400	省广股份	51,600	711,564.00	0.79
48	600537	亿晶光电	95,600	710,308.00	0.79
49	002681	奋达科技	53,200	687,876.00	0.76
50	600303	曙光股份	72,000	649,440.00	0.72
51	300274	阳光电源	42,600	449,004.00	0.50
52	002221	东华能源	35,900	444,801.00	0.49
53	002303	美盈森	43,200	444,096.00	0.49
54	000895	双汇发展	21,100	441,623.00	0.49
55	002539	云图控股	39,900	441,294.00	0.49
56	000571	新大洲A	57,800	440,436.00	0.49
57	002551	尚荣医疗	22,000	438,020.00	0.49
58	000063	中兴通讯	27,400	437,030.00	0.49
59	300512	中亚股份	13,102	436,689.66	0.49
60	000969	安泰科技	41,400	436,356.00	0.48
61	002029	七匹狼	42,700	435,967.00	0.48
62	000667	美好集团	118,100	435,789.00	0.48
63	002004	华邦健康	48,000	435,360.00	0.48
64	600580	卧龙电气	47,800	434,980.00	0.48
64	000001	平安银行	47,800	434,980.00	0.48
65	002309	中利科技	30,600	434,826.00	0.48
66	600027	华电国际	87,800	434,610.00	0.48
67	000762	西藏矿业	25,500	434,265.00	0.48
68	002234	民和股份	20,100	433,758.00	0.48
69	002424	贵州百灵	22,900	433,726.00	0.48

70	000625	长安汽车	29,000	433,260.00	0.48
71	300507	苏奥传感	4,106	433,183.00	0.48
72	002449	国星光电	32,601	432,941.28	0.48
73	600970	中材国际	61,000	432,490.00	0.48
74	000966	长源电力	71,600	432,464.00	0.48
75	000021	深科技	45,800	431,894.00	0.48
76	002751	易尚展示	9,300	431,892.00	0.48
77	000729	燕京啤酒	62,100	431,595.00	0.48
78	000876	新希望	53,600	431,480.00	0.48
79	300359	全通教育	21,800	431,422.00	0.48
80	300133	华策影视	38,000	431,300.00	0.48
81	002714	牧原股份	18,500	430,680.00	0.48
82	002458	益生股份	12,500	430,000.00	0.48
83	002194	武汉凡谷	33,400	429,524.00	0.48
84	000601	韶能股份	50,000	429,500.00	0.48
85	000002	万科A	20,900	429,495.00	0.48
86	000627	天茂集团	56,100	429,165.00	0.48
87	002157	正邦科技	64,400	428,904.00	0.48
88	002081	金螳螂	43,800	428,802.00	0.48
89	000973	佛塑科技	57,100	428,250.00	0.48
90	002152	广电运通	32,200	427,616.00	0.48
91	002801	微光股份	3,330	427,572.00	0.48
92	002047	宝鹰股份	45,700	427,295.00	0.47
93	002477	雏鹰农牧	85,100	427,202.00	0.47
94	000626	如意集团	17,300	426,445.00	0.47
95	002371	七星电子	16,000	425,600.00	0.47
96	002783	凯龙股份	5,100	425,595.00	0.47
97	002249	大洋电机	49,300	425,459.00	0.47
98	300522	世名科技	4,500	425,295.00	0.47
99	000810	创维数字	30,100	423,507.00	0.47
100	000034	神州数码	18,900	421,848.00	0.47
101	002769	普路通	20,595	421,579.65	0.47
102	000402	金融街	40,900	421,270.00	0.47
103	600823	世茂股份	59,700	419,094.00	0.47
104	300242	明家联合	32,200	417,634.00	0.46
105	002070	众和股份	30,000	416,400.00	0.46
106	002562	兄弟科技	34,400	415,552.00	0.46
107	300520	科大国创	5,407	412,662.24	0.46
108	603218	日月股份	854	35,569.10	0.04

109	603877	太平鸟	1,050	22,365.00	0.02
110	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.02
111	000050	深天马 A	800	15,056.00	0.02
112	300276	三丰智能	800	14,520.00	0.02
113	002396	星网锐捷	700	13,790.00	0.02
114	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.01
115	000547	航天发展	509	7,818.24	0.01
116	603035	常熟汽饰	739	7,715.16	0.01
117	300591	万里马	1,838	5,642.66	0.01
118	000693	ST 华泽	332	4,150.00	0.00

## 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 个交易日单元
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 有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交 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

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-

限责任公司						
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	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		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 有限公司	-	-	9,300,000.00	16.73%	-	-
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）有限责任公司	-	-	-	-	-	-
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。

### 11.8 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混合型证券投资基金基金合同》	本基金管理人网站	2016年4月25日
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》	三大证券报及本基金管理人网站	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》	三大证券报及本基金管理人网站	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	《关于增加北京汇成基金销售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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
7	《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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 18 日
8	《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
9	《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管理人网站	2016 年 6 月 14 日
10	《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
11	《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》		
12	《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有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
13	《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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
14	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司定期定额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 7 月 7 日
15	《银华基金管理有限公司关于网上直销系统开展通联支付招商银行卡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 7 月 11 日
16	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金开放申购、转换转入业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 14 日
17	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 19 日
18	《银华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金每笔赎回申请的最低份额、转换转出最低份额及赎回后的最低保有份额的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 21 日

19	《关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 22 日
20	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 8 月 24 日
21	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告》	本基金管理人网站	2016 年 8 月 24 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道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 9 月 20 日
23	《关于增加凤凰金信（银川）投资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》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 28 日
24	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行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 10 月 26 日
25	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第三季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 26 日
26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在民生银行直销银行“基金通”平台开通定期定额投资业务并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 11 月 11 日



27	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海基煜基金销售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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 17 日
28	《关于增加民生证券为旗下部分基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 22 日
29	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道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 11 月 29 日
30	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2016 年 12 月 9 日
31	《银华量化智慧动力灵活配置混合型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 12 月 9 日
32	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 22 日
33	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 29 日
34	《银华基金管理股份有限公司	三大证券报及本基	2016 年 12 月 30 日

	关于旗下部分基金参加农业银行费率优惠活动的公告》	金管理人网站	
35	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 30 日

### 11.8 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》	四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	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东华软件、万科 A、苏宁环球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 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	《银华中证成长股债恒定组合	本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日

	30/70 指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号） 》		
7	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的德尔未来、文化长城、格林美、万里扬、宏图高科估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 1 月 7 日
8	《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》	本基金经理人网站	2016 年 1 月 7 日
9	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司网上费率优惠活动公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 1 月 12 日
10	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的千方科技、初灵信息、万方发展估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 1 月 13 日
11	《关于增加大泰金石投资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》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 1 月 21 日
12	《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经理人网站	2016 年 1 月 22 日
13	《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、	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 2 月 4 日

	胜利精密估值方法调整的公告》		
14	《银华基金管理有限公司关于以通讯方式召开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的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 2 月 23 日
15	《银华基金管理有限公司关于以通讯方式召开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的第一次提示性公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 2 月 24 日
16	《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》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 2 月 24 日
17	《银华基金管理有限公司关于以通讯方式召开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的第二次提示性公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 2 月 25 日
18	《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经理人网站	2016 年 2 月 26 日
19	《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经理人网站	2016 年 3 月 2 日

20	《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》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 15 日
21	《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代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 16 日
22	《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》	四大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 24 日
23	《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金暂停申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 24 日
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的四维图新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 25 日
25	《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经理人网站	2016 年 3 月 25 日
26	《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》	本基金经理人网站	2016 年 3 月 25 日
27	《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金暂停申购(含定期定额投资及转换转入)业务的提示性公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2016 年 3 月 25 日
28	《银华基金管理有限公司关于	三大证券报及本基	2016 年 3 月 31 日

	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》	金管理人网站	
29	《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》	四大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 1 日
30	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大同煤业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 4 月 15 日
31	《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
32	《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》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
33	《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
34	《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》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 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

13.1.2 《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》

13.1.3 《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》

13.1.4 《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》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 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。

### 13.3 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。

银华基金管理股份有限公司  
2017 年 3 月 31 日